

BlackRock[®]

Rapport annuel et états financiers révisés

BlackRock Global Funds (BGF)

R.C.S. Luxembourg : B.6317

Sommaire

Conseil d'administration	2	Global Allocation Fund	522
Gestion et administration	2	Global Corporate Bond Fund	553
Informations générales	4	Global Dynamic Equity Fund	563
Lettre de la Présidente aux Actionnaires	6	Global Equity Income Fund	570
Rapport du Gestionnaire Financier par délégation	8	Global Government Bond Fund	573
Rapport des Administrateurs	18	Global High Yield Bond Fund	596
Rapport sur les rémunérations (non révisé)	22	Global Inflation Linked Bond Fund	618
Bilan	26	Global Long-Horizon Equity Fund	625
Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans	36	Global Multi-Asset Income Fund	627
Compte de résultat et évolution de l'actif net	86	Impact Bond Fund ⁽²⁾	679
Variation du nombre d'actions en circulation	122	India Fund	686
Portefeuille de titres		Japan Flexible Equity Fund	688
Asian Dragon Fund	166	Japan Small & MidCap Opportunities Fund	690
Asian Growth Leaders Fund	168	Latin American Fund	692
Asian High Yield Bond Fund	170	Multi-Theme Equity Fund	694
Asian Multi-Asset Income Fund	178	Natural Resources Fund ⁽⁷⁾	696
Asian Sustainable Equity Fund	189	Next Generation Health Care Fund	698
Asian Tiger Bond Fund	191	Next Generation Technology Fund	701
Brown To Green Materials Fund ⁽²⁾	202	Nutrition Fund	704
China Bond Fund	204	Sustainable Asian Bond Fund	706
China Flexible Equity Fund	214	Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	713
China Fund	216	Sustainable Emerging Markets Bond Fund	721
China Impact Fund	218	Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	729
China Innovation Fund	220	Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	732
China Multi-Asset Fund ⁽²⁾	222	Sustainable Energy Fund	741
China Onshore Bond Fund ⁽²⁾	224	Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	743
Circular Economy Fund	228	Sustainable Global Allocation Fund ⁽²⁾	796
Climate Action Equity Fund	230	Sustainable Global Bond Income Fund	804
Climate Action Multi-Asset Fund	232	Sustainable Global Infrastructure Fund	819
Continental European Flexible Fund	239	Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾	821
Developed Markets Sustainable Equity Fund	241	Swiss Small & MidCap Opportunities Fund ⁽⁵⁾	851
Dynamic High Income Fund	243	Systematic China A-Share Opportunities Fund	853
Emerging Europe Fund ⁽³⁾	273	Systematic China Environmental Tech Fund ⁽²⁾	856
Emerging Markets Bond Fund	275	Systematic Global Equity High Income Fund	858
Emerging Markets Corporate Bond Fund	285	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund ⁽²⁾	864
Emerging Markets Equity Income Fund	289	Systematic Sustainable Global SmallCap Fund ⁽⁴⁾	869
Emerging Markets Fund	292	United Kingdom Fund	877
Emerging Markets Impact Bond Fund	295	US Basic Value Fund	879
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	297	US Dollar Bond Fund	881
Emerging Markets Sustainable Equity Fund	307	US Dollar High Yield Bond Fund	913
ESG Flex Choice Cautious Fund	309	US Dollar Reserve Fund	932
ESG Flex Choice Growth Fund	311	US Dollar Short Duration Bond Fund	935
ESG Flex Choice Moderate Fund	313	US Flexible Equity Fund	954
ESG Global Conservative Income Fund	315	US Government Mortgage Impact Fund	956
ESG Global Multi-Asset Income Fund	336	US Growth Fund	961
ESG Multi-Asset Fund	356	US Mid-Cap Value Fund	963
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾	368	US Sustainable Equity Fund	965
Euro Bond Fund	387	World Energy Fund	967
Euro Corporate Bond Fund	401	World Financials Fund	969
Euro Reserve Fund	409	World Gold Fund	971
Euro Short Duration Bond Fund	411	World Healthscience Fund	973
Euro-Markets Fund	421	World Mining Fund	976
European Equity Income Fund	423	World Real Estate Securities Fund	978
European Focus Fund	425	World Technology Fund	981
European Fund	427	Annexe aux États Financiers	984
European High Yield Bond Fund	429	Rapport du Réviseur d'entreprises	1000
European Special Situations Fund	436	Appendice I – Catégories d'actions (non révisé)	1002
European Sustainable Equity Fund	438	Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)	1010
European Value Fund	440	Appendice III – Admissibilité au Plan d'épargne en actions français (« PEA ») (non révisé)	1015
FinTech Fund	442	Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé)	1016
Fixed Income Global Opportunities Fund	444	Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé)	1076
Future Consumer Fund	518	Appendice VI – Publication d'informations en matière de durabilité (non révisé)	1120
Future Of Transport Fund	520		

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Le rapport annuel et les comptes révisés sont présentés en anglais. La traduction française n'est publiée qu'à titre d'information.

Les souscriptions ne doivent être faites que sur la base du Prospectus en vigueur et du DIC PRIIP correspondant, complétés par le rapport annuel et les états financiers révisés les plus récents ainsi que le rapport intermédiaire et les états financiers non révisés. Des exemplaires sont disponibles au siège de la société auprès de l'équipe locale de Services aux Investisseurs, de l'Agent de Transfert, de la Société de Gestion ou de l'un des Distributeurs.

Conseil d'administration⁽¹⁾⁽²⁾⁽³⁾

Denise Voss, Présidente
Paul Freeman
Bettina Mazzocchi (nommée avec effet le 6 octobre 2022)
Geoffrey D. Radcliffe
Davina Saint
Keith Saldanha
Vasiliki Pachatouridi (nommée avec effet au 3 mars 2023)

⁽¹⁾ Tous les Administrateurs de BlackRock Global Funds sont des Administrateurs non exécutifs.

⁽²⁾ Bettina Mazzocchi, Geoffrey D. Radcliffe, Keith Saldanha et Vasiliki Pachatouridi sont des employés du Groupe BlackRock (dont font partie la Société de Gestion, les financiers par délégation et le Distributeur Principal), et Paul Freeman est un ancien employé du Groupe BlackRock.

⁽³⁾ Denise Voss et Davina Saint sont des Administratrices indépendantes.

Gestion et administration

Société de gestion

BlackRock (Luxembourg) S.A.
35A, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Gestionnaires Financiers par délégation

BlackRock Financial Management, Inc.
Park Avenue Plaza, 55 East 52nd Street, New York, NY 10055,
États-Unis

BlackRock Investment Management, LLC
100 Bellevue Parkway, Wilmington, Delaware 19809, États-Unis

BlackRock Investment Management (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue, Londres EC2N 2DL

BlackRock (Singapore) Limited
18-01 Twenty Anson, 20 Anson Road, Singapour, 079912

Sous-gestionnaires Financiers par délégation

BlackRock Asset Management North Asia Limited
16/F Champion Tower, 3 Garden Road, Central, Hong Kong

BlackRock Japan Co. Limited
1-8-3 Marunouchi, Chiyoda-ku, Tokyo 100-8217, Japon

BlackRock Investment Management (Australia) Limited
Level 26, 101 Collins Street, Melbourne 3000, Australie

Distributeur principal

BlackRock Investment Management (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue
Londres EC2N 2DL
Royaume-Uni

Dépositaire

The Bank of New York Mellon SA/ NV,
Succursale de Luxembourg
2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Gestion et administration suite

Administrateur

The Bank of New York Mellon SA/ NV,
Succursale de Luxembourg
2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Agent de Transfert et Teneur de registre

J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.
European Bank & Business Center
6, route de Trèves, Building C
L-2633 Senningerberg
Grand-Duché de Luxembourg

Commissaire aux comptes

Ernst & Young S.A.
35E avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg,
Grand-Duché de Luxembourg

Conseillers Juridiques

À compter du 1^{er} janvier 2023 :
Arendt & Medernach S.A.
41A avenue John F. Kennedy,
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Jusqu'au 31 décembre 2022 :

Linklaters LLP
35, avenue John F. Kennedy,
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Agent Chargé de l'Introduction en Bourse

J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.
European Bank & Business Center
6, route de Trèves, Building C
L-2633 Senningerberg
Grand-Duché de Luxembourg

Agent de prêt de titres

BlackRock Advisors (UK) Limited
12 Throgmorton Avenue
Londres EC2N 2DL
Royaume-Uni

Agents payeurs

La liste des Agents Payeurs est donnée aux pages 4 et 5.

Siège Social

2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Gestion et administration suite

Demandes de renseignements

En l'absence d'autres dispositions, les demandes de renseignements concernant la Société doivent être adressées comme suit :

Demandes de renseignements écrites :

BlackRock Investment Management (UK) Limited

c/o BlackRock (Luxembourg) S.A.

P.O. Box 1058

L-1010 Luxembourg

Grand-Duché de Luxembourg

Autres demandes de renseignements :

Téléphone : + 44 207 743 3300

Fax : + 44 207 743 1143

Site Web : www.blackrockinternational.com

Adresse e-mail : investor.services@blackrock.com

Informations générales

Prospectus en vigueur

Le Prospectus de BlackRock Global Funds (la « Société ») et son addendum, ainsi que le DIC PRIIP correspondant pour les Compartiments et des exemplaires du formulaire d'ouverture de compte, peuvent être obtenus auprès du Centre de Services aux Investisseurs, de la Société de Gestion ou de l'un des Représentants ou Distributeurs. Des exemplaires des Statuts de la Société, ainsi que du Rapport annuel, des États financiers annuels révisés, du Rapport intermédiaire et des États financiers non révisés, peuvent être également obtenus gratuitement auprès de ces bureaux et auprès de tout Agent payeur. Tous ces documents sont également disponibles à l'adresse www.blackrockinternational.com.

Représentants

Le représentant à Hong Kong est BlackRock Asset Management North Asia Limited, 16/F, Champion Tower, 3 Garden Road Central, Hong Kong.

Le représentant en Suisse est BlackRock Asset Management Schweiz AG, Bahnhofstrasse 39, 8001 Zurich, Suisse.

Le représentant en Pologne est Dubiński Jeleński Masiarz and Partners Sp.K ul. Zielna 37, 00-108 Varsovie, Pologne.

Le représentant en Israël est Altshuler Shaham Mutual Funds Management Ltd, 19A Habarzel St., Ramat Hachayal, Tel Aviv, Israël.

Le chef de file en Irlande est BlackRock Asset Management Ireland Limited et BlackRock Investment Management (UK) Limited agit en tant que chef de file au Royaume-Uni.

Agréments

La Société est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) aux termes de la législation luxembourgeoise du 17 décembre 2010 telle qu'amendée. Les consentements réglementaires ont été obtenus ou les notifications appropriées ont été effectuées pour la distribution des Actions des Compartiments de la Société dans les pays suivants :

Luxembourg, Pays-Bas et Royaume-Uni.

Les consentements réglementaires ont été obtenus ou les notifications appropriées ont été effectuées pour la distribution des Actions des Compartiments dans les pays suivants :

Allemagne, Autriche, Bahreïn, Belgique, Brunei, Chili, Chine, Corée, Danemark, Émirats arabes unis, Espagne, Finlande, France, Gibraltar, Grèce, Hong Kong, Hongrie, Islande, Irlande, Israël, Italie, Japon, Jersey, Liechtenstein, Macao, Malte, Norvège, Oman, Pologne, Portugal, République slovaque, République tchèque, Singapour, Suède, Suisse, Taïwan, Uruguay.

Les Actions de certains Fonds à compartiments multiples peuvent également être proposées occasionnellement dans d'autres juridictions sur une base d'investissement privé.

La Société est dûment enregistrée auprès de la Comisión Nacional de Mercado de Valores en Espagne sous le numéro 140.

Agents payeurs

France

CACEIS Bank
1/3, Place Valhubert
75013 Paris

Italie

Allfunds Bank S.A.
Succursale de Milan
Via Bocchetto, 6
20123 Milan

Italie suite

BNP Paribas Securities
Services
Succursale de Milan
Piazza Lina Bo Bardi, 3
20124 Milan

Italie suite

Société Générale Securities
Services S.p.A.
Via Benigno Crespi, 19/A, MAC II
20159 Milan

Luxembourg

(Agent payeur central)
J.P. Morgan Bank
Luxembourg S.A. European
Bank & Business Center,
6, route de Trèves, Building C
L-2633 Senningerberg

Banca Monte
dei Paschi
di Siena S.p.A.
Piazza Salimbeni 3
53100 Sienne

CACEIS Bank
Succursale italienne
Piazza Cavour, 2
20121 Milan

Suisse

State Street Bank International
GmbH
Munich, succursale de Zurich
Beethovenstrasse 19
CH-8027 Zurich

Banca Sella Holding S.p.A.
Piazza Gaudenzio Sella 1
13900 Bielle

Iccrea Banca S.p.A.
Via Lucrezia Romana, 41/47
00178 Rome

Informations générales suite

Agents payeurs suite

Italie suite

State Street Bank GmbH
– Succursale Italia
Siège Social
Via Ferrante Aporti, 10
20125 Milan

Pologne

Bank Handlowy w Warszawie
Spółka Akcyjna
ul. Senatorska 16
00-923 Varsovie

Suède

BlackRock Investment
Management (UK) Limited
Succursale de Stockholm
Norrandsgatan 16
111 43 Stockholm

Publication des cours et avis aux actionnaires

Les avis de convocation sont envoyés aux actionnaires nominatifs et (si la loi l'exige) publiés dans les journaux indiqués par les Administrateurs ainsi que dans le Recueil des Sociétés et Associations du Mémorial Luxembourg. Les prix des actions peuvent être obtenus durant les heures ouvrables auprès du Centre de Services aux Investisseurs local et sur le site Internet de BlackRock. Ils seront également publiés dans les pays où cette publication est requise, conformément à la loi applicable et à la discrétion des Administrateurs dans un certain nombre de journaux ou de plates-formes électroniques du monde entier. La Société décline toute responsabilité en cas d'erreur ou de retard dans la publication ou de non-publication des prix. L'historique des prix de toutes les actions peut être obtenu auprès de l'Agent administratif ou de l'équipe locale de Service aux Investisseurs.

Achats et ventes

Une liste détaillée des titres de placement achetés et vendus pour n'importe quel Compartiment au cours de l'exercice est disponible, sur demande et gratuitement, au Siège social indiqué à la page 2 ou dans les bureaux des Représentants indiqués à la page 4.

Politique en matière de divulgation

Les informations concernant les avoirs et les valeurs en fin de mois pour tous les Compartiments BlackRock Global Funds seront accessibles à tout actionnaire de BlackRock Global Funds, sur demande, auprès du Centre de Services aux Investisseurs, après un délai 10 jours ouvrables suivant la fin de mois concernée. BlackRock Global Funds se réserve le droit, avant de fournir lesdites informations, de demander aux actionnaires de signer un document de non-divulgateion.

À l'intention des investisseurs allemands

Le présent rapport annuel et les états financiers vérifiés (le « Rapport et États financiers ») peuvent être traduits dans d'autres langues. Ces traductions présenteront exactement les mêmes informations et répondront à la même interprétation que le Rapport et les États financiers originaux rédigés en langue anglaise. En cas de contradictions entre le Rapport et les États financiers originaux rédigés en langue anglaise et le Rapport et les États financiers traduits dans une autre langue, la version originale prévaudra, sauf dans la mesure où (et uniquement dans ce cas) les exigences juridiques en vigueur d'un territoire dans lequel les actions sont vendues imposent que, pour toute action intentée sur la base des informations communiquées dans le Rapport et les États financiers publiés dans une langue autre que l'anglais, la langue de publication du Rapport et des États financiers sur la base desquels l'action est intentée soit déterminante. Tout litige en lien avec les termes du Rapport et des États financiers, indépendamment de la langue de publication du Rapport et des États financiers, sera régi et interprété selon le droit luxembourgeois.

Le prospectus, le DIC PRIIP et un relevé complet des changements du portefeuille sont gratuitement disponibles auprès de l'Agent payeur allemand.

Veuillez noter qu'une notification concernant la distribution d'actions en République fédérale d'Allemagne en vertu de la section 310 du Code allemand de l'investissement en capital (Kapitalanlagegesetzbuch) n'a pas été déposée s'agissant du Compartiment suivant : Asian Multi-Asset Income Fund. Par conséquent, les actions de ce Compartiment ne peuvent être distribuées en République fédérale d'Allemagne.

Lettre de la Présidente aux Actionnaires

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023

Cher Actionnaire,

Je vous fais parvenir la présente lettre afin de vous informer des activités de BlackRock Global Funds (« BGF ») au cours des douze mois qui ont précédé le 31 août 2023. Au 31 août 2023, la gamme BGF comprenait 105 compartiments (dénommés individuellement « Compartiment » et collectivement « Compartiments »).

Les douze derniers mois ont été caractérisés par une volatilité persistante sur les marchés boursiers mondiaux, notamment du fait de l'incertitude quant à l'ampleur et l'impact potentiel des hausses des taux d'intérêt. Cependant, les cours des actions dans le monde entier ont généralement augmenté en réaction à la baisse des taux d'inflation, à la perspective d'un assouplissement de la politique monétaire et aux signes d'une résilience relative des grandes économies face aux difficultés récentes.

Le 1^{er} mars 2022, en raison de l'exposition d'investissement importante du Compartiment Emerging Europe Fund (aux fins du reste du présent paragraphe, le « Compartiment ») à la Russie, le Conseil d'administration a décidé de suspendre temporairement les souscriptions et les rachats, la conversion de toutes les catégories d'actions et la détermination des valeurs liquidatives, à la discrétion du Compartiment, conformément au prospectus. Au 31 août 2023, l'évaluation, les souscriptions et les rachats dans le Compartiment restent suspendus jusqu'à nouvel ordre. Voir Point 1 aux États financiers pour de plus amples informations.

Après les fortes augmentations observées début 2022, les prix de l'énergie ont commencé à diminuer au cours du second semestre, réduisant ainsi certaines des pressions inflationnistes dans les principales économies mondiales. Plus récemment, l'éclatement d'un conflit entre Israël et la Palestine en octobre 2023 pourrait entraîner une nouvelle hausse des prix du pétrole plus tard dans l'année. Après avoir atteint un pic en juin 2022, le taux d'inflation aux États-Unis a entamé une baisse qui s'est poursuivie tout au long de la période. Dans la zone euro, les hausses annuelles de prix avaient atteint 10,6 % en octobre 2022, mais avaient reculé à 5,3 % en août 2023. Le taux d'inflation au Royaume-Uni a atteint 11,1 % en octobre 2022, un record en 40 ans, avant de retomber de même à 6,8 % en juillet 2023. Dans la plupart des pays développés, les taux d'inflation ont été lents à baisser. Une situation qui a rendu plus difficile la tâche des banques centrales, qui ont continué à resserrer la politique monétaire.

Ces douze derniers mois, la réouverture de l'économie chinoise après une longue période de restrictions liées à la COVID-19 a eu un impact significatif sur les marchés mondiaux. À la suite d'importantes manifestations en novembre 2022, les autorités chinoises ont assoupli les restrictions imposées par la pandémie, suscitant l'espoir d'une stimulation du commerce international et de la croissance intérieure.

Au second semestre 2022, la persistance d'une forte inflation et la hausse des taux d'intérêt ont fait craindre une nouvelle récession mondiale. Toutefois, la résilience des données économiques de fin 2022 et des premiers mois de 2023 a permis d'apaiser ces inquiétudes : si l'activité dans des secteurs tels que l'industrie manufacturière et la construction s'est ralentie, les performances du marché du travail sont restées largement positives et les dépenses dans les commerces de détail ont bien résisté. Dans sa Mise à jour de juillet 2023 des perspectives de l'économie mondiale, le Fonds monétaire international (« FMI ») prévoit une expansion de l'économie mondiale de 3,0 % en 2023, contre 3,4 % en 2022 et 6,1 % en 2021. Le FMI a ajouté que les taux d'inflation avaient baissé plus lentement qu'il ne l'avait projeté précédemment et a appelé les banques centrales à contenir les risques pour le système financier.

Les marchés ont connu une volatilité importante au printemps 2023, avec la montée des préoccupations relatives aux pressions placées sur le système financier mondial par le resserrement des politiques monétaires. L'effondrement de la Silicon Valley Bank aux États-Unis a été suivi d'une perte de confiance dans Crédit Suisse, malgré des mesures conjointes des régulateurs qui ont contribué à rétablir le calme. En mai 2023, les marchés ont été perturbés par le face à face entre les démocrates et les républicains sur le plafond de la dette aux États-Unis. Cependant, les deux parties sont parvenues à un accord pour relever le plafond de la dette au début du mois suivant, apaisant les craintes des investisseurs.

Pendant l'été, les cours des actions ont progressé alors que l'économie américaine (en particulier) est restée dynamique malgré la hausse des taux d'intérêt, tandis que l'inflation a poursuivi une trajectoire à la baisse tant aux États-Unis qu'en Europe. Les grandes valeurs technologiques ont bénéficié de l'optimisme autour du développement de l'intelligence artificielle. Tout au long de la période, les signes d'une reprise post-pandémie plus lente que prévu en Chine ont été un facteur de volatilité, bien que les investisseurs aient par ailleurs accueilli favorablement la nouvelle que le gouvernement chinois planifiait de nouvelles mesures pour stimuler l'économie nationale en berne.

La volatilité des actifs à revenu fixe s'est maintenue au cours de l'année. La courbe de rendement des bons du Trésor américain est restée inversée, ce qui signifie que les taux d'intérêt à court terme sont supérieurs aux taux d'intérêt à long terme. Il s'agit d'un phénomène relativement inhabituel et historiquement associé à un risque accru de récession. Les obligations de sociétés de qualité supérieure ont affiché des performances tout aussi faibles, leurs taux augmentant plus vite que ceux des obligations d'État.

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

Lettre de la Présidente aux Actionnaires

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Les actifs sous gestion («ASG») de la gamme BGF ont chuté de 2,2%, passant de 158,7 milliards d'USD à 155,3 milliards d'USD au cours de l'année.

Certains fonds obligataires consacrés à la fintech et à l'investissement axé sur la génération de revenus ont été les moins performants. Le Compartiment ESG Global Conservative Income Fund a perdu 43,0% d'ASG au cours de la période, passant de 644,7 millions d'EUR à 367,2 millions d'EUR. Les ASG du Compartiment FinTech Fund se sont contractés de 38,6% au cours de la période, la confiance dans le sous-secteur ayant été entamée par l'effondrement d'une importante bourse d'échange de devises numériques, entre autres facteurs négatifs. En parallèle, le Compartiment Euro Bond Fund a perdu 39,0% de sa valeur, ses ASG passant de 3,2 milliards d'EUR à 1,9 milliard d'EUR, tandis que les ASG du Compartiment China Bond Fund ont chuté de 32,2%, passant de 38,7 milliards de CNH à 26,3 milliards de CNH.

Un certain nombre de Compartiments axés sur le développement durable ont enregistré de bonnes performances, les actifs du Compartiment Sustainable Asian Bond Fund ayant progressé de 161,7% pour atteindre 112,2 millions d'USD. Le Compartiment Asian Sustainable Equity Fund a quant à lui progressé de 83,4% pour atteindre 8,4 millions d'USD. De même, le Compartiment Global Long-Horizon Equity Fund a connu une progression notable de 30,3% à 1,4 milliard d'USD et le Compartiment World Financials Fund a pris 26,3%, clôturant la période à 1,8 milliard d'USD.

Les réglementations ont continué d'évoluer dans toute l'Europe, et plusieurs de ces évolutions pourraient avoir des conséquences pour les investisseurs. Parmi les principaux changements, notons :

- ▶ À partir du 1^{er} janvier 2023, l'extension du Règlement PRIIP a entraîné des changements importants pour le secteur des compartiments. Les DICI des OPCVM ont été remplacés par les exigences révisées des DIC PRIIP. Les changements incluent la manière dont les risques, les scénarios de performance et les coûts de transaction sont calculés.
- ▶ Le Règlement sur la publication d'informations en matière de finance durable («SFDR», Sustainable Finance Disclosure Regulation) de l'Union européenne est entré en vigueur en mars 2021. Le règlement impose de nouvelles obligations de transparence et de déclaration aux sociétés de gestion de placement, tant au niveau de l'entreprise que du produit. Certaines parties du cadre ont été finalisées en 2022 et adoptées début 2023. Dans le même temps, l'UE travaille sur un système de classification à l'échelle de l'UE, un «cadre». Cette taxonomie vise à fournir aux entreprises et aux investisseurs un langage commun afin d'identifier dans quelle mesure les activités économiques peuvent être considérées comme durables sur le plan environnemental. Il y a également des mesures à prendre pour améliorer le reporting, la Directive sur le reporting de durabilité des entreprises («CSRD») devant être mise en place à partir de 2024. Dans le cadre de la réglementation CSRD, les sociétés devront rendre compte de la durabilité dans leurs chaînes d'approvisionnement («Scope 3») et intégrer la double matérialité à leur reporting. En plus de la façon dont les questions relatives à la durabilité affectent l'entreprise, la double matérialité exige de préciser la façon dont les activités de l'entreprise affectent les questions environnementales, climatiques et sociales. Le gouvernement luxembourgeois a récemment pris de nouvelles mesures pour encourager les investissements dans les compartiments écologiquement durables, en réduisant la taxe d'abonnement pour les compartiments qui répondent à certains critères environnementaux.
- ▶ La nouvelle réglementation de l'Autorité de conduite financière du Royaume-Uni en matière de droits des consommateurs est entrée en vigueur le 31 juillet 2023, avec un impact sur le contenu des communications des fonds d'investissement, y compris les fonds domiciliés au Royaume-Uni ou commercialisés auprès d'investisseurs de détail au Royaume-Uni. La réglementation impose un devoir de diligence aux sociétés de services financiers vis-à-vis de leurs clients de détail, en les engageant à leur fournir de bons résultats et en leur donnant la preuve de la manière dont ils le font. Les normes «plus strictes et plus claires» de protection des consommateurs s'appliquent désormais aux produits nouveaux et existants ouverts à la vente aux investisseurs de détail britanniques.

Si vous avez des questions sur l'un de ces sujets, veuillez nous contacter sur notre site Internet à l'adresse www.blackrockinternational.com, ou par e-mail à l'adresse investor.services@blackrock.com.

Veillez agréer l'expression de nos salutations distinguées,

Denise Voss
Présidente

Septembre 2023

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023

Examen du marché

La période a commencé par un regain de volatilité sur les marchés financiers, car on craignait que la persistance d'une inflation élevée et la hausse des taux d'intérêt n'entraînent une récession dans bon nombre des principales économies mondiales. Vers la fin de l'année 2022 et au début de l'année 2023, les actions se sont toutefois redressés, les taux d'inflation ayant baissé aux États-Unis et en Europe, ce qui a fait naître l'espoir que le rythme des hausses de taux d'intérêt pourrait commencer à ralentir.

La décision du gouvernement chinois de mettre fin à sa politique de « zéro COVID » en cas de pandémie a également donné un coup de fouet aux marchés mondiaux. Les confinements imposés pendant la majeure partie de l'année 2022 dans les grandes villes telles que Shanghai, Pékin et Chengdu ont provoqué un ralentissement important de la production industrielle dans le pays et ont également eu des répercussions considérables sur les chaînes d'approvisionnement mondiales. Au départ, la réouverture de la Chine a amélioré la situation sur un certain nombre de marchés ainsi que dans le secteur des matières premières. Cependant, tout au long de l'année 2023 et jusqu'à ce jour, des signes d'une reprise post-pandémie inégale dans le pays persistent. Cela a eu pour effet d'inquiéter les investisseurs quant au ralentissement de la croissance mondiale et d'inciter le gouvernement de Pékin à introduire une série de mesures de relance économique.

Bien qu'il y ait eu des éléments de faiblesse dans certains secteurs au cours de la période, les déclarations de bénéfices des entreprises ont été majoritairement conformes ou supérieures aux attentes, autre facteur ayant ainsi soutenu la résilience des cours des actions. Les sociétés financières, par exemple, ont bénéficié de la hausse des taux d'intérêt et de la vigueur du marché de l'emploi, tandis que les actions technologiques se sont redressées grâce à la perspective d'un assouplissement de la politique monétaire et à l'espoir que l'intelligence artificielle puisse offrir des avantages de croissance significatifs.

Les cours des actions ont particulièrement baissé en mars et avril 2023, lorsqu'une crise de liquidité dans certaines parties du secteur bancaire a mis en lumière les conséquences potentielles du resserrement monétaire. En parallèle, l'absence d'accord entre le président démocrate Joe Biden et ses homologues républicains au Congrès à propos du relèvement du plafond de la dette du gouvernement américain a suscité des inquiétudes quant au risque d'un défaut de paiement. De ce fait, les marchés mondiaux ont connu un regain de volatilité vers la fin du mois de mai, avant que l'impasse ne soit finalement résolue avec la conclusion d'un accord.

La période d'incertitude pour les marchés obligataires mondiaux s'est poursuivie. Les rendements des bons du Trésor américain à 10 ans, qui évoluent à l'inverse des prix, ont atteint un sommet de 4,2% en octobre. Ce pic a été causé en partie par la réaction fortement négative des investisseurs aux plans controversés de réduction des impôts présentés par

le gouvernement britannique de Liz Truss à la fin du mois de septembre. Le rendement des obligations d'État britanniques à 10 ans a atteint 4,5% avant de retomber. Avec une inflation toujours supérieure aux objectifs des banques centrales aux États-Unis et en Europe tout au long de la période considérée, les rendements sont restés élevés en prévision de nouveaux relèvements de taux. Cependant, les obligations indexées, qui évoluent en fonction des prévisions d'inflation plutôt que des hausses de prix réelles, ont également subi des pertes importantes pendant une grande partie de la période.

Performance des compartiments

Un tableau indiquant les rendements de performance de la catégorie d'actions primaire de chaque Compartiment par rapport à l'indice de référence applicable est repris de la page 11 à la page 16. Vous trouverez ci-dessous un bref résumé de la performance des Compartiments.

Les données citées relatives à la performance correspondent à la principale (A) catégorie d'actions du Compartiment concerné, et sont exprimées dans la devise de référence du Compartiment, après déduction des commissions.

Performance des compartiments d'actions

Le Compartiment Global Equity Income Fund a progressé de 10,83%, derrière son indice de référence, le MSCI All Country World Net TR Index, lequel a augmenté de 13,95%. Le Compartiment Global Dynamic Equity Fund, plus axé sur la croissance, a progressé de 9,73%, derrière son indice de référence (60% S&P 500/ 40% FTSE World Ex-US Index), qui a progressé de 16,08%.

Les actions des petites et moyennes entreprises ont récupéré une partie des pertes subies au début de l'année 2022, grâce à l'amélioration de la confiance des investisseurs et à la relative résistance des économies. Le Compartiment Systematic Sustainable Global SmallCap Fund a progressé de 11,35%, dépassant son indice de référence, le MSCI All Country World Small Cap Index, qui a progressé de 8,67%.

Concernant les compartiments nationaux, le Japan Small & MidCap Opportunities Fund a augmenté de 11,39%, derrière l'indice S&P Japan Mid Small Cap Index, qui a progressé de 18,85%. Le Compartiment Swiss Small & MidCap Opportunities Fund a enregistré une hausse de 4,11%, derrière son indice de référence, le Switzerland SPI Extra Index, qui a progressé de 5,90%.

Le Compartiment Continental European Flexible Fund a progressé de 18,88%, devant son indice de référence, le FTSE World Europe ex UK Index, qui a gagné 16,87%. Le Compartiment European Fund a progressé de 16,66% par rapport au MSCI Europe Index, qui a gagné 13,50%. Le Compartiment European Equity Income Fund a augmenté de 8,73% par rapport au même indice de référence. Le Compartiment European Focus Fund a progressé de 16,57%, tandis que le Compartiment European Special Situations Fund a gagné 15,54%. Tous deux sont également référencés par rapport au MSCI Europe Index.

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Le Compartiment US Growth Fund a progressé de 21,05 %, juste derrière l'indice Russell 1000 Growth Index, qui a gagné 21,94 %. Le Compartiment US Basic Value Fund a augmenté de 6,51 %, soit un résultat inférieur à celui de l'indice Russell 1000 Value Index, qui a progressé de 8,59 % au cours de la période.

Le Compartiment Japan Flexible Equity Fund a progressé de 24,18 %, derrière le MSCI Japan Index, qui lui a grimpé de 21,08 %.

Les performances des fonds asiatiques et des fonds des marchés émergents se sont stabilisées, grâce à la réouverture de l'économie chinoise et à l'apaisement des craintes relatives à un ralentissement de l'économie mondiale. Le Compartiment Asian Growth Leaders Fund a récupéré 0,43 %, devant son indice de référence, le MSCI All Country Asia ex Japan Index, qui a reculé de 0,61 %. Le Compartiment Asian Dragon Fund a progressé de 0,07 %, devant le même indice de référence.

Le Compartiment India Fund a gagné 3,92 %, devant son indice de référence, le MSCI India Index, qui a progressé de 1,47 %. Le Compartiment Emerging Markets Fund, qui a une exposition plus étendue à l'univers d'investissement des marchés émergents, a augmenté de 3,09 % et a terminé la période devant son indice de référence, le MSCI Emerging Markets Index, qui a progressé de 1,25 %. Le Compartiment Emerging Markets Equity Income Fund, qui partage le même indice de référence, a enregistré une hausse de 10,17 %. Le Compartiment Latin American Fund a affiché une progression de 24,46 %, devant son indice de référence, le MSCI Emerging Markets Latin America Index, lequel a augmenté de 19,33 %.

Dans le secteur des ressources naturelles, le Compartiment World Energy Fund a bénéficié de la hausse des prix de l'énergie et progressé de 11,84 %, à l'instar de son indice de référence, le MSCI World Energy Index 10/40 Index (Net) (USD), lequel a gagné 11,85 % au cours de la période. Le Compartiment World Mining Fund a progressé de 11,96 %, soit une sous-performance par rapport à son indice de référence, le MSCI ACWI Metals and Mining 30 % Buffer 10/40 Index, qui a progressé de 16,85 %. Le Compartiment World Gold Fund a gagné 24,35 %, devant son indice de référence, le FTSE Gold Mines Index, qui a augmenté de 19,81 %.

Le Compartiment World Technology Fund a progressé de 15,96 %, contre une hausse de 27,34 % pour le MSCI All Country World Information Technology Index. Le Compartiment Nutrition Fund a perdu 6,02 % sur la période, tandis que le Compartiment Future Of Transport Fund a augmenté de 6,87 % et le Compartiment FinTech Fund a baissé de 3,57 %. Aucun de ces Compartiments spécialisés n'a d'indice de référence.

Performance des Compartiments d'actifs mixtes

Le Compartiment diversifié Global Allocation Fund – qui investit dans un mélange de titres à revenu fixe, d'actions et de liquidités – a grimpé de 5,29 %, derrière son indice de référence, qui a avancé de 9,23 % (l'indice de référence est composé à 36 % du S&P 500 Index, à 24 % du FTSE

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

World Index (Ex-US), à 24 % de l'ICE BofAML Current 5Yr US Treasury Index et à 16 % du FTSE Non-USD World Government Bond Index).

Le Compartiment Global Multi-Asset Income Fund a progressé de 2,91 % au cours de la période. Le Compartiment allie la capacité de répartir activement dans une gamme complète de catégories d'actifs et de régions géographiques de manière descendante, en cherchant à ajouter de la valeur grâce à une sélection de titres ascendante effectuée dans chaque catégorie clé d'actifs par des équipes spécialisées. Le Compartiment n'a pas d'indice de référence.

La performance des Compartiments de titres à revenu fixe

Le Compartiment Global Government Bond Fund a perdu 2,62 %, derrière son indice de référence, le FTSE World Government Bond USD Hedged Index, qui a perdu 1,06 %. Le Compartiment Euro Bond Fund a reculé de 1,72 %, contre une baisse de 2,29 % pour son indice de référence, le Bloomberg Euro Aggregate 500mm+ Bond Index. Le Compartiment Global Corporate Bond Fund a progressé de 1,75 %, contre une hausse de 1,82 % pour son indice de référence, le Bloomberg Global Aggregate Corporate Bond USD Hedged Index.

Le Compartiment Euro Corporate Bond Fund a progressé de 1,44 %, tandis que son indice de référence, l'ICE BofAML Euro Corporate Index, a gagné 0,96 %. Le Compartiment Euro Short Duration Bond Fund a progressé de 1,01 %. Le Compartiment n'a pas d'indice de référence.

Le Compartiment Global High Yield Bond Fund a grimpé de 5,54 %, derrière son indice de référence, le BofA Merrill Lynch Global High Yield Constrained USD Hedged Index, qui a gagné 7,38 %. Le Compartiment Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund a augmenté de 15,03 % au cours de la période. Il a ainsi devancé son indice de référence, le JP Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified Index, qui a progressé de 13,08 %. Le grand Compartiment Sustainable Emerging Markets Bond Fund a progressé de 6,83 %, devant son indice de référence, le JP Morgan ESG-Emerging Markets Bond Index Global Diversified, lequel a progressé de 5,27 %.

Le Compartiment Asian Tiger Bond Fund a reculé de 0,87 %, contre une hausse de 1,91 % pour son indice de référence, le JP Morgan Asian Credit Index. Le Compartiment Fixed Income Global Opportunities Fund a augmenté de 0,74 %, tandis que le Compartiment Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund a perdu 1,75 %. Aucun des fonds mondiaux à revenu fixe n'a d'indice de référence.

Perspective

Jusqu'à présent, les marchés boursiers ont réussi à effacer les pertes de 2022, l'inflation ayant continué à baisser et les banques centrales ayant indiqué qu'elles mettraient bientôt un terme aux relèvements des taux d'intérêt. Bien que les données économiques aient été mitigées, les investisseurs espèrent toujours qu'un « atterrissage en douceur » sera possible.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Cependant, les effets de la hausse des taux d'intérêt ont commencé à se faire sentir auprès des consommateurs, des entreprises et du secteur financier mondial, dont la stabilité a été menacée. Pourtant, si l'inflation se maintient au-dessus de l'objectif, en particulier dans le contexte de l'intensification du conflit au Moyen-Orient, de nouveaux relèvements pourraient s'imposer, avec un risque accru de ralentissement de la croissance. À court terme, les performances économiques mondiales restent en grande partie tributaires de la capacité de la Chine à relancer sa croissance après l'assouplissement de ses restrictions post-pandémie.

Malgré la volatilité élevée observée pendant la majeure partie de 2022 et 2023, le secteur des entreprises est resté raisonnablement résilient à ce jour. Néanmoins, les hausses récentes des prix des actions ont rendu les valorisations moins attrayantes par rapport au début de l'année. Il existe certainement des entreprises capables de résister à la tempête actuelle et d'obtenir de bons résultats en dépit de la faiblesse économique qui se profile. Au final, même s'il ne fait aucun doute qu'il y aura des défis à relever dans les mois à venir, des opportunités continueront également à se présenter.

Septembre 2023

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Politique environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »)

Le tableau de rendement présente l'approche de gestion des investissements adoptée pour chaque Compartiment. Il identifie également les Compartiments et Fonds qui promeuvent des caractéristiques environnementales ou sociales (« Fonds de l'Article 8 ») ou qui ont pour objectif des investissements durables (« Fonds de l'Article 9 »), conformément au règlement de l'UE sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (« SFDR »). Des informations détaillées sur la manière dont les Fonds de l'Article 8 et de l'Article 9 ont atteint ces caractéristiques et objectifs sont incluses dans la section supplémentaire du Rapport annuel sur la Publication d'informations en matière de durabilité.

Pour tout autre Compartiment ne répondant pas aux critères SFDR des Compartiments de l'Article 8 ou 9, les investissements sous-jacents à ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques écologiquement durables. Lorsqu'il choisit les investissements à sélectionner, le Gestionnaire Financier par délégation a accès à un éventail de sources de données, y compris des données sur les principales incidences négatives (« PIN »). Cependant, bien que BlackRock prenne en compte les risques ESG pour tous les portefeuilles et que ces risques puissent coïncider avec des thèmes environnementaux ou sociaux associés aux PIN, sauf disposition contraire dans le prospectus, les Compartiments ne s'engagent pas à prendre en compte les PIN pour orienter la sélection de leurs investissements.

Vous trouverez, dans le tableau ci-dessous, les rendements de la Catégorie d'Actions A de capitalisation pour chaque Compartiment, après déduction des commissions et dépenses, qui a été choisie à titre représentatif. Pour les autres Catégories d'Actions, les rendements de la performance peuvent être communiqués sur demande.

La méthode de calcul est fondée sur des normes sectorielles.

La performance passée n'est pas indicatrice de la performance future et ne doit pas être le seul facteur pris en considération pour le choix d'un produit. Tous les investissements financiers comportent un élément de risque, Si bien que la valeur d'un investissement et le revenu qui en découle varient et que le montant de l'investissement initial ne peut être garanti. Le Fonds investit dans une part importante d'actifs libellés dans des devises autres que le dollar US ; par conséquent, les variations du taux de change concerné affecteront la valeur de l'investissement. Les chiffres de la performance ne tiennent pas compte des frais et commissions qui peuvent être prélevés au moment de la souscription ou du rachat d'actions. Les taux et les bases d'imposition peuvent varier de temps à autre. Les souscriptions ne doivent être faites que sur la base du Prospectus en vigueur, dont le rapport annuel et les états financiers révisés les plus récents ainsi que le rapport intermédiaire et les états financiers non révisés font partie intégrante, ainsi que des Documents d'informations clés (DIC PRIIP). Des exemplaires sont disponibles auprès des Services aux Investisseurs, de l'Agent de Transfert, de la Société de Gestion ou de l'un des Représentants ou Distributeurs. La gamme BGF est réservée aux non-ressortissants américains. Elle n'est pas offerte à la vente ni vendue aux États-Unis, pas plus que dans les territoires ou les possessions des États-Unis.

Les Compartiments ne sont pas autorisés à la vente au public dans toutes les juridictions. Pour de plus amples informations sur la distribution d'actions des Compartiments, veuillez consulter la section Agréments, à la page 4.

	Performance pour l'exercice clôturé le 31 août				Performance pour la période de 10 ans clôturée le 31 août		Date de lancement	Classification SFDR
	2023	Résultats par année civile 2022	2021	2020	2023	2023		
Asia Pacific Equity Income Fund 'A' Non Dist (USD)⁽¹⁾	- (17,73%)	1,88%	14,36%	-	18/9/2009	Autre		
MSCI All Country Asia Pacific ex Japan Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	- (17,48%)	(2,90%)	22,44%	-				
Asian Dragon Fund 'A' Non Dist (USD)	0,07%	(18,41%)	(4,51%)	20,72%	64,85%	2/1/1997	Autre	
MSCI All Country Asia ex Japan Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	(0,61%)	(19,67%)	(4,72%)	25,02%	53,65%			
Asian Growth Leaders Fund 'A' Non Dist (USD)	(0,43%)	(24,12%)	(5,52%)	30,29%	63,50%	31/10/2012	Autre	
MSCI All Country Asia ex Japan Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	(0,61%)	(19,67%)	(4,72%)	25,02%	53,65%			
Asian High Yield Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	(4,35%)	(18,68%)	(17,41%)	10,89%	-	1/12/2017	Autre	
ICE BofAML Blended Index: ACCY, 20% Lvl4 Cap 3% Constrained Index	3,25%	(13,30%)	(6,21%)	8,43%	-			
Asian Multi-Asset Income Fund 'A' Non Dist (USD)	(0,49%)	(14,98%)	(5,05%)	8,72%	-	20/1/2016	Autre	
Reference (50% MSCI Asia ex Japan Index/25% JP Morgan, Asia Credit Index/25% Markit iBoxx ALBI Index)	1,44%	(14,31%)	(3,62%)	16,61%	-			

⁽¹⁾ Compartiment dissous au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁶⁾ La mesure de performance comprise dans le tableau ci-dessus est indiquée à titre de référence uniquement. Pour de plus amples informations, veuillez consulter le prospectus.

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Performance pour l'exercice clôturé le 31 août 2023				Performance pour la période de 10 ans clôturée le 31 août 2023		Date de lancement	Classification SFDR
	Résultats par année civile	2022	2021	2020	2023	2023		
Asian Sustainable Equity Fund 'A' Non Dist (USD)	(1,32 %)	-	-	-	-	-	29/3/2022	Article 8
MSCI All Country Asia ex Japan (USD)	(0,61 %)	-	-	-	-	-		
Asian Tiger Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	(0,87 %)	(16,06 %)	(7,41 %)	6,58 %	14,86 %	14,86 %	2/2/1996	Autre
JP Morgan Asian Credit Index (USD)	1,91 %	(11,02 %)	(2,44 %)	6,33 %	34,72 %	34,72 %		
Brown To Green Materials Fund 'A' Non Dist (USD)⁽²⁾	1,40 %	-	-	-	-	-	6/6/2023	Article 8
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-	-		
China Bond Fund 'A' Non Dist (CNH)	(0,92 %)	(4,33 %)	(2,03 %)	8,18 %	43,60 %	43,60 %	11/11/2011	Autre
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-	-		
China Flexible Equity Fund 'A' Non Dist (USD)	(12,39 %)	(30,46 %)	(16,67 %)	36,96 %	-	-	31/10/2017	Article 8
MSCI China 10/40 Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	(9,75 %)	(23,61 %)	(12,79 %)	34,52 %	-	-		
China Fund 'A' Non Dist (USD)	(14,12 %)	(31,45 %)	(14,97 %)	46,61 %	30,79 %	30,79 %	24/6/2008	Article 8
MSCI EM China 10/40 Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	(7,82 %)	(21,53 %)	(20,14 %)	30,75 %	27,41 %	27,41 %		
China Impact Fund 'A' Non Dist (USD)	(21,59 %)	(32,72 %)	1,55 %	39,62 %	-	-	9/10/2019	Article 9
MSCI China 10/40 Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	(9,75 %)	(23,61 %)	(7,64 %)	38,26 %	-	-		
China Innovation Fund 'A' Non Dist (USD)	(2,65 %)	-	-	-	-	-	12/5/2022	Article 8
MSCI CHINA ALL SHARES Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	(9,75 %)	-	-	-	-	-		
China Multi-Asset Fund 'A' Non Dist (USD)⁽²⁾	(2,70 %)	-	-	-	-	-	13/7/2023	Article 8
ICE BofA US T-Bill 0-3 Month Index	0,71 %	-	-	-	-	-		
China Onshore Bond Fund 'A' Non Dist (CNH)⁽²⁾	0,86 %	-	-	-	-	-	6/9/2022	Article 8
1Y China Household Savings Deposits Rate Index	1,01 %	-	-	-	-	-		
Circular Economy Fund 'A' Non Dist (USD)	10,46 %	(26,99 %)	17,58 %	22,01 %	-	-	2/10/2019	Article 9
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-	-		
Climate Action Equity Fund 'A' Non Dist (USD)	3,75 %	(20,90 %)	-	-	-	-	9/12/2021	Article 9
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-	-		
Climate Action Multi-Asset Fund 'A' Non Dist (EUR)	(6,86 %)	(12,79 %)	-	-	-	-	9/12/2021	Article 9
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-	-		
Continental European Flexible Fund 'A' Non Dist (EUR)	18,88 %	(24,37 %)	25,84 %	25,37 %	169,55 %	169,55 %	24/11/1986	Article 8
FTSE World Europe ex UK Index (USD) ⁽⁶⁾	16,87 %	(11,97 %)	25,16 %	2,83 %	126,27 %	126,27 %		
Developed Markets Sustainable Equity Fund 'A' Non Dist (USD)	8,66 %	(24,26 %)	-	-	-	-	17/6/2021	Article 8
MSCI World Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	15,60 %	(18,14 %)	-	-	-	-		
Dynamic High Income Fund 'A' Non Dist (USD)	4,44 %	(18,51 %)	10,01 %	3,79 %	-	-	6/2/2018	Autre
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-	-		
Emerging Europe Fund 'A' Non Dist (EUR)⁽³⁾	64,88 %	(71,56 %)	22,90 %	(12,69 %)	-	-	29/12/1995	Autre
MSCI Emerging Markets Europe 10/40 Index (Net) (EUR) ⁽⁶⁾	(40,24 %)	(65,50 %)	21,73 %	(19,14 %)	-	-		
Emerging Markets Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	7,69 %	(16,78 %)	(2,97 %)	6,09 %	23,00 %	23,00 %	1/10/2004	Autre
JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified Index (USD)	5,77 %	(17,78 %)	(1,80 %)	5,26 %	34,49 %	34,49 %		
Emerging Markets Corporate Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	2,48 %	(13,04 %)	(2,23 %)	8,79 %	30,66 %	30,66 %	18/2/2013	Autre
JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Broad Diversified (USD)	4,93 %	(12,26 %)	0,91 %	7,13 %	43,14 %	43,14 %		
Emerging Markets Equity Income Fund 'A' Non Dist (USD)	10,17 %	(21,44 %)	(0,73 %)	13,50 %	42,92 %	42,92 %	12/8/2011	Autre
MSCI Emerging Markets Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	1,25 %	(20,09 %)	(2,54 %)	18,31 %	34,26 %	34,26 %		
Emerging Markets Fund 'A' Non Dist (USD)	3,09 %	(28,04 %)	(3,06 %)	23,19 %	37,08 %	37,08 %	30/11/1993	Autre
MSCI Emerging Markets Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	1,25 %	(20,09 %)	(2,54 %)	18,31 %	34,26 %	34,26 %		
Emerging Markets Impact Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	3,02 %	(12,32 %)	-	-	-	-	12/7/2021	Article 9
JP Morgan ESG Green Bond Emerging Markets Index (USD Hedged) ⁽⁶⁾	2,68 %	(14,25 %)	-	-	-	-		

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁶⁾ La mesure de performance comprise dans le tableau ci-dessus est indiquée à titre de référence uniquement. Pour de plus amples informations, veuillez consulter le prospectus.

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Performance pour l'exercice clôturé le 31 août 2023				Performance pour la période de 10 ans clôturée le 31 août 2023		Date de lancement	Classification SFDR
	Résultats par année civile							
	2022	2021	2020	2023	2023			
Emerging Markets Local Currency Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	12,82%	(9,06%)	(8,24%)	2,15%	(4,28%)		2/2/2007	Autre
JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index (USD)	11,34%	(11,69%)	(8,57%)	2,69%	(0,72%)			
Emerging Markets Sustainable Equity Fund 'A' Non Dist (USD)	6,04%	(23,12%)	–	–	–		29/6/2021	Article 8
MSCI Emerging Markets Index (Net) ⁽⁶⁾	1,25%	(20,09%)	–	–	–			
ESG Flex Choice Cautious Fund 'A' Non Dist (USD)	0,11%	(13,86%)	–	–	–		15/12/2021	Article 8
The Fund has no benchmark	–	–	–	–	–			
ESG Flex Choice Growth Fund 'A' Non Dist (USD)	8,26%	(17,90%)	–	–	–		15/12/2021	Article 8
The Fund has no benchmark	–	–	–	–	–			
ESG Flex Choice Moderate Fund 'A' Non Dist (USD)	5,28%	(16,54%)	–	–	–		15/12/2021	Article 8
The Fund has no benchmark	–	–	–	–	–			
ESG Global Conservative Income Fund 'A' Non Dist (EUR)	(2,57%)	(12,53%)	3,81%	3,26%	–		12/9/2018	Article 8
The Fund has no benchmark	–	–	–	–	–			
ESG Global Multi-Asset Income Fund 'A' Non Dist (USD)	1,31%	–	–	–	–		27/1/2022	Article 8
The Fund has no benchmark	–	–	–	–	–			
ESG Multi-Asset Fund 'A' Non Dist (EUR)	(5,42%)	(14,29%)	14,97%	10,06%	53,37%		4/1/1999	Article 8
Reference (50% MSCI World Index/50% FTSE World Government Bond Euro Hedged Index) (EUR)	2,32%	(13,27%)	12,92%	6,29%	79,41%			
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund 'A' Non Dist (USD)⁽⁴⁾	4,13%	(15,03%)	–	–	–		22/6/2021	Article 8
Bloomberg Global Aggregate Corporate USD Hedged Index, BBG Barclays Global High Yield Index Excl CMBS & EMG 2% Capped USD Hedged Index and JP Morgan EMBI ESG Global Diversified USD Hedged Index	4,95%	(14,49%)	–	–	–			
Euro Bond Fund 'A' Non Dist (EUR)	(1,72%)	(17,25%)	(3,88%)	4,03%	7,76%		31/3/1994	Autre
Bloomberg Euro-Aggregate 500mm+ Bond Index (EUR)	(2,29%)	(17,22%)	(2,88%)	4,07%	8,66%			
Euro Corporate Bond Fund 'A' Non Dist (EUR)	1,44%	(14,72%)	(1,85%)	2,53%	10,56%		31/7/2006	Autre
ICE BofAML Euro Corporate Index (EUR)	0,96%	(13,94%)	(1,02%)	2,65%	11,38%			
Euro Reserve Fund 'A' Non Dist (EUR)	1,78%	(0,31%)	(0,69%)	(0,57%)	(1,76%)		24/7/2009	Autre
The Fund has no benchmark	–	–	–	–	–			
Euro Short Duration Bond Fund 'A' Non Dist (EUR)	1,01%	(5,56%)	(1,45%)	0,32%	(0,92%)		4/1/1999	Autre
The Fund has no benchmark	–	–	–	–	–			
Euro-Markets Fund 'A' Non Dist (EUR)	16,31%	(19,39%)	27,23%	8,69%	92,75%		4/1/1999	Article 8
MSCI EMU Index (Net) (EUR) ⁽⁶⁾	20,26%	(12,47%)	22,16%	(1,02%)	102,62%			
European Equity Income Fund 'A' Non Dist (EUR)	8,73%	(11,88%)	20,05%	0,14%	85,97%		3/12/2010	Article 8
MSCI Europe Index (Net) (EUR) ⁽⁶⁾	13,50%	(9,49%)	25,13%	(3,32%)	97,42%			
European Focus Fund 'A' Non Dist (EUR)	16,57%	(24,89%)	28,64%	20,71%	89,59%		14/10/2005	Article 8
MSCI Europe Index (Net) (EUR) ⁽⁶⁾	13,50%	(9,49%)	25,13%	(3,32%)	97,42%			
European Fund 'A' Non Dist (EUR)	16,66%	(24,73%)	28,95%	20,28%	92,54%		30/11/1993	Article 8
MSCI Europe Index (Net) (EUR) ⁽⁶⁾	13,50%	(9,49%)	25,13%	(3,32%)	97,42%			
European High Yield Bond Fund 'A' Non Dist (EUR)	5,16%	(13,01%)	3,97%	3,26%	–		23/7/2015	Article 8
Bloomberg Pan European High Yield 3% Issuer Constrained Index EUR Hedged (EUR)	6,42%	(10,72%)	3,46%	2,32%	–			
European Special Situations Fund 'A' Non Dist (EUR)	15,54%	(25,92%)	25,68%	9,98%	126,58%		14/10/2002	Article 8
MSCI Europe Index (Net) (EUR) ⁽⁶⁾	13,50%	(9,49%)	25,13%	(3,32%)	91,83%			
European Sustainable Equity Fund 'A' Non Dist (EUR)	10,20%	(21,93%)	–	–	–		17/6/2021	Article 8
MSCI Europe Index (Net) (EUR) ⁽⁶⁾	13,50%	(9,49%)	–	–	–			

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁶⁾ La mesure de performance comprise dans le tableau ci-dessus est indiquée à titre de référence uniquement. Pour de plus amples informations, veuillez consulter le prospectus.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Performance pour l'exercice clôturé le 31 août 2023				Performance pour la période de 10 ans clôturée le 31 août 2023		Date de lancement	Classification SFDR
	Résultats par année civile	2022	2021	2020				
European Value Fund 'A' Non Dist (EUR) MSCI Europe Value Index (Net) (EUR) ⁽⁶⁾	16,49%	(4,66%)	21,47%	3,23%	82,06%		8/1/1997	Article 8
	15,31%	(1,08%)	21,82%	(12,91%)	69,63%			
FinTech Fund 'A' Non Dist (USD) The Fund has no benchmark	(3,57%)	(40,81%)	(0,06%)	42,55%	-		4/9/2018	Article 8
	-	-	-	-	-			
Fixed Income Global Opportunities Fund 'A' Non Dist (USD) The Fund has no benchmark	0,74%	(6,51%)	-	5,74%	20,32%		31/1/2007	Autre
	-	-	-	-	-			
Future Consumer Fund 'A' Non Dist (USD) The Fund has no benchmark	4,78%	(43,73%)	-	-	-		9/6/2021	Article 8
	-	-	-	-	-			
Future Of Transport Fund 'A' Non Dist (USD) The Fund has no benchmark	6,87%	(23,83%)	20,38%	52,93%	-		4/9/2018	Article 9
	-	-	-	-	-			
Global Allocation Fund 'A' Non Dist (USD) Reference (36% S&P 500 Index/24% FTSE World (Ex-US) Index/ 24% ICE BofAML Current 5Yr US Treasury Index/ 16% FTSE Non-USD World Government Bond Index) (USD)	5,29%	(16,33%)	6,27%	19,72%	50,57%		3/1/1997	Autre
	9,23%	(15,59%)	10,13%	13,34%	79,04%			
Global Corporate Bond Fund 'A' Non Dist (USD) Bloomberg Global Aggregate Corporate Bond USD Hedged Index (USD)	1,75%	(14,93%)	(2,04%)	8,10%	21,45%		19/10/2007	Autre
	1,82%	(14,11%)	(0,79%)	8,26%	30,25%			
Global Dynamic Equity Fund 'A' Non Dist (USD) Reference (60% S&P 500 Index/40% FTSE World (ex US) Index) (USD)	9,73%	(19,71%)	14,78%	24,48%	103,80%		28/2/2006	Autre
	16,08%	(16,52%)	21,72%	15,08%	156,45%			
Global Equity Income Fund 'A' Non Dist (USD) MSCI All Country World Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	10,83%	(14,83%)	16,76%	5,48%	68,48%		12/11/2010	Article 8
	13,95%	(18,36%)	18,54%	16,25%	127,32%			
Global Government Bond Fund 'A' Non Dist (USD) FTSE World Government Bond USD Hedged Index (USD)	(2,62%)	(14,06%)	(2,97%)	7,10%	12,55%		13/5/1987	Article 8
	(1,06%)	(12,86%)	(2,29%)	6,11%	19,85%			
Global High Yield Bond Fund 'A' Non Dist (USD) BofA Merrill Lynch Global High Yield Constrained USD Hedged Index (USD)	5,54%	(12,87%)	2,22%	6,98%	37,34%		8/6/2007	Article 8
	7,38%	(11,38%)	3,04%	6,48%	53,56%			
Global Inflation Linked Bond Fund 'A' Non Dist (USD) Bloomberg World Government Inflation-Linked 1-20yr Index USD Hedged (USD)	(2,77%)	(9,20%)	4,22%	5,61%	28,14%		19/6/2009	Autre
	(1,62%)	(8,51%)	5,55%	6,38%	38,34%			
Global Long-Horizon Equity Fund 'A' Non Dist (USD) MSCI All Country World Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	9,94%	(18,88%)	19,62%	21,35%	127,67%		29/2/1996	Article 8
	13,95%	(18,36%)	18,54%	16,25%	127,32%			
Global Multi-Asset Income Fund 'A' Non Dist (USD) The Fund has no benchmark	2,91%	(13,11%)	5,81%	5,58%	34,57%		28/6/2012	Autre
	-	-	-	-	-			
Impact Bond Fund 'A' Non Dist (EUR)⁽²⁾ ICE Green, Social & Sustainable Bond Index, EUR Hedged Index	0,80%	-	-	-	-		6/10/2022	Article 9
	1,67%	-	-	-	-			
India Fund 'A' Non Dist (USD) MSCI India TR Net 10/40 Index (USD) ⁽⁶⁾ , b ¹	3,92%	(14,84%)	25,58%	9,38%	195,73%		2/2/2005	Autre
	1,47%	(7,74%)	26,64%	17,93%	179,82%			
Japan Flexible Equity Fund 'A' Non Dist (JPY) MSCI Japan Index (Net) (JPY) ⁽⁶⁾	24,18%	(8,05%)	11,00%	17,80%	137,14%		28/2/2005	Autre
	21,08%	(4,49%)	13,44%	8,76%	152,22%			
Japan Small & MidCap Opportunities Fund 'A' Non Dist (JPY) S&P Japan Mid Small Cap Index (JPY) ⁽⁶⁾	11,39%	(10,41%)	12,71%	2,52%	109,86%		13/5/1987	Autre
	18,85%	(0,21%)	8,76%	0,02%	152,90%			
Latin American Fund 'A' Non Dist (USD) MSCI Emerging Markets Latin America Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	24,46%	7,27%	(15,55%)	(17,88%)	7,13%		8/1/1997	Autre
	19,33%	9,04%	(8,09%)	(13,80%)	14,98%			
Multi-Theme Equity Fund 'A' Non Dist (USD) MSCI All Country World Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	5,12%	(20,22%)	13,45%	-	-		10/7/2020	Article 8
	13,95%	(18,36%)	18,54%	-	-			

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁶⁾ La mesure de performance comprise dans le tableau ci-dessus est indiquée à titre de référence uniquement. Pour de plus amples informations, veuillez consulter le prospectus.

^{b1} L'indice de référence MSCI India Index a été changé le 31 juillet 2020.

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Performance pour l'exercice clôturé le 31 août 2023				Performance pour la période de 10 ans clôturée le 31 août 2023		Date de lancement	Classification SFDR
	Résultats par année civile	2022	2021	2020				
Natural Resources Fund⁽⁷⁾ 'A' Non Dist (USD)	7,34%	16,77%	29,34%	2,22%	57,89%		15/4/2011	Autre
S&P Global Natural Resources Index (USD) ⁽⁶⁾	7,48%	9,59%	24,40%	(0,05%)	64,78%			
Next Generation Health Care Fund 'A' Non Dist (USD)	6,80%	(21,06%)	-	-	-		7/6/2021	Article 8
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-			
Next Generation Technology Fund 'A' Non Dist (USD)	4,94%	(50,76%)	1,55%	115,25%	-		4/9/2018	Article 8
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-			
Nutrition Fund 'A' Non Dist (USD)	(6,02%)	(21,92%)	4,75%	19,59%	11,99%		9/2/2010	Article 9
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-			
Sustainable Asian Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	(0,47%)	(15,06%)	(3,39%)	-	-		20/10/2020	Article 8
JP Morgan ESG Asia Credit Index (USD)	1,97%	(11,68%)	(2,81%)	-	-			
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	9,01%	(12,65%)	(13,47%)	15,90%	-		9/7/2018	Article 8
JP Morgan ESG Blended Emerging Market Bond Index (Sovereign) ⁽⁶⁾	9,14%	(15,35%)	(5,98%)	4,94%	-			
Sustainable Emerging Markets Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	6,83%	(17,62%)	(3,21%)	8,49%	-		9/7/2018	Article 8
JP Morgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	5,27%	(18,92%)	(2,35%)	5,78%	-			
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	2,39%	(13,18%)	(2,01%)	6,91%	-		9/7/2018	Article 8
JP Morgan ESG Corporate Emerging Market Bond Index Broad Diversified	5,41%	(10,63%)	0,76%	7,15%	-			
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	15,03%	(8,73%)	(9,05%)	3,24%	-		9/7/2018	Article 8
JP Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Market Global Diversified	13,08%	(11,70%)	(9,53%)	4,00%	-			
Sustainable Energy Fund 'A' Non Dist (USD)	11,84%	(18,32%)	15,73%	50,42%	129,90%		6/4/2001	Article 9
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-			
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund 'A' Non Dist (EUR)	(1,75%)	(9,51%)	(1,41%)	-	-		24/4/2020	Article 8
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-			
Sustainable Global Allocation Fund 'A' Non Dist (USD)⁽²⁾	11,60%	-	-	-	-		4/10/2022	Article 8
Reference (60% MSCI All Country World Index, 40% Bloomberg Global Aggregate Index)	13,23%	-	-	-	-			
Sustainable Global Bond Income Fund 'A' Non Dist (USD)	2,94%	(7,35%)	(0,72%)	2,49%	-		16/7/2018	Article 8
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-			
Sustainable Global Infrastructure Fund 'A' Non Dist (USD)	(0,32%)	(15,11%)	-	-	-		24/6/2021	Article 9
FTSE 50/50 Developed Core Infrastructure Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	(7,50%)	(5,79%)	-	-	-			
Sustainable World Bond Fund 'A' Non Dist (USD)⁽⁴⁾	(1,39%)	(13,72%)	(1,69%)	6,63%	14,82%		4/9/1985	Article 8
Bloomberg Global Aggregate USD Hedged Index (USD) ⁽⁶⁾	0,55%	(11,22%)	(1,39%)	5,58%	23,14%			
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund 'A' Non Dist (CHF)⁽⁵⁾	4,11%	(30,56%)	32,80%	13,23%	181,69%		8/1/2008	Article 8
Switzerland SPI Extra Index (CHF) ⁽⁶⁾	5,90%	(24,02%)	22,19%	8,07%	126,47%			
Systematic China A-Share Opportunities Fund 'A' Non Dist (USD)	(12,65%)	(27,22%)	0,33%	44,41%	-		26/10/2017	Article 8
MSCI China A Onshore Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	(12,94%)	(27,23%)	4,03%	40,04%	-			
Systematic China Environmental Tech Fund 'A' Non Dist (USD)⁽²⁾	(3,00%)	-	-	-	-		15/6/2023	Article 8
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-			
Systematic Global Equity High Income Fund 'A' Non Dist (USD)	8,96%	(14,84%)	16,92%	8,91%	71,76%		13/10/2006	Autre
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-			

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁶⁾ La mesure de performance comprise dans le tableau ci-dessus est indiquée à titre de référence uniquement. Pour de plus amples informations, veuillez consulter le prospectus.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Performance pour l'exercice clôturé le 31 août 2023				Performance pour la période de 10 ans clôturée le 31 août 2023		Date de lancement	Classification SFDR
	Résultats par année civile							
	2023	2022	2021	2020				
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund 'A' Non Dist (USD)⁽²⁾	10,90 %	-	-	-	-	-	22/9/2022	Article 8
The Fund has no benchmark	-	-	-	-	-	-		
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund 'A' Non Dist (USD)⁽⁴⁾	11,35 % (16,02 %)	17,94 %	12,46 %	81,85 %	4/11/1994	Article 8		
MSCI All Country World Small Cap Index (USD) ⁽⁶⁾	8,67 % (18,67 %)	16,09 %	16,33 %	104,43 %				
United Kingdom Fund 'A' Non Dist (GBP)	6,05 % (21,86 %)	14,27 %	4,32 %	64,46 %	31/12/1985	Autre		
FTSE All-Share Index (GBP) ⁽⁶⁾	5,23 % 0,34 %	18,32 %	(9,82 %)	70,59 %				
US Basic Value Fund 'A' Non Dist (USD)	6,51 % (5,62 %)	19,70 %	1,10 %	84,53 %	8/1/1997	Autre		
Russell 1000 Value Index (USD) ⁽⁶⁾	8,59 % (7,54 %)	25,16 %	2,80 %	139,93 %				
US Dollar Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	(2,09 %) (14,59 %)	(1,94 %)	7,83 %	11,60 %	7/4/1989	Autre		
Bloomberg US Aggregate Index (USD)	(1,19 %) (13,01 %)	(1,54 %)	7,51 %	15,86 %				
US Dollar High Yield Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	5,86 % (11,99 %)	4,27 %	5,81 %	40,24 %	29/10/1993	Article 8		
Bloomberg US High Yield 2 % Constrained Index (USD)	7,19 % (11,18 %)	5,26 %	7,05 %	54,81 %				
US Dollar Reserve Fund 'A' Non Dist (USD)	4,11 % 1,35 %	(0,02 %)	0,36 %	9,61 %	30/11/1993	Autre		
The Fund has no benchmark	-	-	-	-				
US Dollar Short Duration Bond Fund 'A' Non Dist (USD)	1,63 % (4,96 %)	(0,77 %)	3,04 %	9,60 %	31/10/2002	Autre		
ICE BoAML 1-3 Year US Government/Corporate Index (USD) ⁽⁶⁾	1,64 % (3,76 %)	(0,42 %)	3,34 %	11,20 %				
US Flexible Equity Fund 'A' Non Dist (USD)	12,25 % (15,28 %)	24,03 %	17,28 %	182,62 %	31/10/2002	Article 8		
Russell 1000 Index (USD) ⁽⁶⁾	15,40 % (19,13 %)	26,45 %	20,96 %	226,29 %				
US Government Mortgage Impact Fund 'A' Non Dist (USD)	(3,82 %) (13,19 %)	(1,82 %)	5,07 %	3,96 %	2/8/1985	Article 9		
FTSE Mortgage Index (USD)	(2,10 %) (11,81 %)	(1,24 %)	4,03 %	11,54 %				
US Growth Fund 'A' Non Dist (USD)	21,05 % (40,57 %)	17,65 %	37,42 %	212,17 %	30/4/1999	Article 8		
Russell 1000 Growth Index (USD) ⁽⁶⁾	21,94 % (29,14 %)	27,60 %	38,49 %	327,13 %				
US Mid-Cap Value Fund 'A' Non Dist (USD)	6,26 % (5,68 %)	25,77 %	4,51 %	122,93 %	13/5/1987	Autre		
S&P US Mid Small Cap Index (USD) ⁽⁶⁾	5,65 % (15,44 %)	23,52 %	17,17 %	153,69 %				
US Sustainable Equity Fund 'A' Non Dist (USD)	8,89 % (29,46 %)	-	-	-	17/6/2021	Article 8		
Russell 1000 Index (USD) ⁽⁶⁾	15,40 % (19,13 %)	-	-	-				
World Energy Fund 'A' Non Dist (USD)	11,84 % 39,58 %	41,21 % (28,54 %)	4,28 %	6/4/2001	Autre			
MSCI World Energy 10/40 Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	11,85 % 42,24 %	39,29 % (29,76 %)	36,30 %					
World Financials Fund 'A' Non Dist (USD)	23,15 % (19,39 %)	16,11 %	8,47 %	95,66 %	3/3/2000	Article 8		
MSCI All Country World Index Financials Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	10,05 % (9,84 %)	24,35 %	(3,78 %)	83,07 %				
World Gold Fund 'A' Non Dist (USD)	24,35 % (17,00 %)	(10,59 %)	28,38 %	(1,05 %)	30/12/1994	Autre		
FTSE Gold Mines Index (Cap) (USD) ⁽⁶⁾	19,81 % (15,47 %)	(12,72 %)	23,22 %	1,28 %				
World Healthscience Fund 'A' Non Dist (USD)	9,23 % (5,21 %)	14,19 %	13,99 %	169,41 %	6/4/2001	Article 8		
MSCI World Health Care Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	10,09 % (5,41 %)	19,80 %	13,52 %	161,20 %				
World Mining Fund 'A' Non Dist (USD)	11,96 % 1,03 %	16,13 %	33,29 %	36,91 %	24/3/1997	Autre		
MSCI ACWI Metals and Mining 30 % Buffer 10/40 Index ⁽⁶⁾ , b2	16,85 % (0,97 %)	14,08 %	33,96 %	82,41 %				
World Real Estate Securities Fund 'A' Non Dist (USD)	(6,53 %) (29,82 %)	26,83 %	(3,49 %)	46,69 %	25/2/2013	Autre		
FTSE EPRA/NAREIT Developed Index ⁽⁶⁾	(5,19 %) (25,09 %)	26,09 %	(9,04 %)	37,79 %				
World Technology Fund 'A' Non Dist (USD)	15,96 % (43,06 %)	8,01 %	85,50 %	348,84 %	3/3/1995	Article 8		
MSCI All Country World Information Technology Index (Net) (USD) ⁽⁶⁾	27,34 % (31,07 %)	27,36 %	45,61 %	433,76 %				

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁶⁾ La mesure de performance comprise dans le tableau ci-dessus est indiquée à titre de référence uniquement. Pour de plus amples informations, veuillez consulter le prospectus.

^{b2} L'indice de référence Euromoney Global Mining Constrained Weights Net Total Return Index a changé de nom le 18 août 2020.

Les informations communiquées dans le présent rapport sont historiques et ne fournissent pas nécessairement d'indications sur les performances futures.

Rapport du Gestionnaire Financier par délégation

Aperçu de la performance

Du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Informations relatives à la performance des Compartiments et aux indices de référence

Sauf indication contraire, la performance est indiquée sur la base du prix de la VL avec revenu réinvesti. Les chiffres de la performance du Compartiment sont calculés au net des commissions, des dépenses et des remboursements de commissions annuels. Toutes les données relatives aux Compartiments et aux indices sont enregistrées dans la devise de référence et converties dans la devise appropriée.

Les changements de composition ou de nom d'un indice de référence ou d'un Compartiment effectués avant le 1^{er} janvier 2020 n'ont pas été communiqués.

Rapport des Administrateurs

Déclaration sur le gouvernement d'entreprise

Introduction

BlackRock Global Funds (la « Société ») est une société anonyme constituée, conformément aux lois du Grand-Duché de Luxembourg, en tant que société d'investissement à capital variable. La Société a été autorisée par la Commission de surveillance du secteur financier (la « CSSF ») comme organisme de placement collectif en valeurs mobilières conformément aux dispositions de la Partie I de la loi du 17 décembre 2010, telle qu'amendée le cas échéant, et est réglementée par cette loi. La Société respecte les principes fixés par la révision du code de conduite 2022 (le « Code ») de l'Association luxembourgeoise des fonds d'investissement (« ALFI ») publié par cette dernière en juin 2022.

Le Conseil d'administration de la Société (le « Conseil ») s'engage à maintenir les plus hauts niveaux de gouvernance d'entreprise et est responsable vis-à-vis des actionnaires de la gouvernance des affaires de la Société. Le Conseil a pris en compte les principes et les recommandations du Code et a mis en place un cadre de gouvernance d'entreprise qu'il juge approprié pour une adhésion aux principes du Code, au vu de la nature de sa structure en tant que société d'investissement. Le Conseil d'administration considère que la Société a respecté les principes du Code pour l'exercice clos le 31 août 2023.

Cette déclaration résume la structure et les processus de gouvernance d'entreprise de la Société pour la période examinée allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023.

Composition du Conseil

Le Conseil est actuellement composé de sept Administrateurs non-exécutifs (dont deux Administrateurs indépendants). Le Conseil s'engage à conserver un juste équilibre des compétences, de l'expérience, de l'indépendance et des connaissances de ses membres.

Les parcours professionnels des Administrateurs, aux pages 20 et 21 illustrent collectivement l'étendue de leurs connaissances et de leur expérience en matière d'investissement, leurs compétences dans le domaine des affaires et de la finance ainsi que leur maîtrise des réglementations, qui leur permettent d'assurer une gestion stratégique efficace, une supervision et une gouvernance appropriée de la Société. BlackRock estime que la composition actuelle constitue un bon équilibre pour le Conseil.

L'article 13 des statuts de la Société prévoit, conformément au droit luxembourgeois, que les Administrateurs soient élus par les actionnaires lors de leur assemblée générale annuelle pour une période se terminant à l'assemblée générale annuelle suivante et jusqu'à l'élection de leurs successeurs. Tout Administrateur qui quitte ses fonctions est tenu de confirmer au Conseil et à la CSSF que sa démission n'est pas liée à de quelconques problèmes en relation avec la Société ou de quelconques réclamations à l'encontre de cette dernière.

Le Conseil est favorable à un renouvellement planifié et progressif du Conseil. BlackRock s'engage à veiller à ce que les Administrateurs candidats à l'élection par les actionnaires possèdent les compétences nécessaires au maintien de cet équilibre. Le Conseil s'engage à effectuer un examen annuel de sa performance et de ses activités.

Les Administrateurs sont constamment tenus de veiller à ce qu'ils aient suffisamment de temps pour remplir leurs tâches. Des informations détaillées sur les autres nominations et engagements de chaque Administrateur (y compris la Présidente) sont consultables auprès du Conseil et du groupe BlackRock.

Avant qu'un nouvel Administrateur ne soit proposé aux actionnaires, ce dernier bénéficiera d'une initiation complète comprenant la communication d'informations importantes concernant ses tâches et responsabilités en tant qu'Administrateur et concernant la Société. En outre, un nouvel Administrateur est tenu d'accorder un peu de temps aux représentants de BlackRock, afin de se familiariser avec les différents processus jugés nécessaires pour une bonne exécution de ses tâches et responsabilités envers la Société.

La politique de la Société est d'encourager les Administrateurs à se tenir informés des développements relatifs à la Société. Les Administrateurs ont assisté et continueront d'assister à des séances d'actualisation et d'information organisées par les entités BlackRock. De plus, les Administrateurs reçoivent régulièrement des comptes rendus provenant, notamment, de commissaires aux comptes, de spécialistes en stratégie d'investissement, de spécialistes du risque, de dépositaires et de conseillers juridiques en lien avec tout développement de produit proposé ou toute modification des lois et réglementations qui pourrait affecter la Société.

Responsabilités du Conseil

Le Conseil se réunit au moins tous les trimestres et, au besoin, de façon ponctuelle. Le Conseil reçoit des informations en temps voulu, sous une forme et d'une qualité lui permettant de remplir ses fonctions. Le Conseil est responsable de la réussite à long terme de la Société et reconnaît être responsable de la gestion, de la direction et du contrôle de la Société, dans le cadre de contrôles prudents et efficaces permettant d'évaluer et de gérer les risques. Le Conseil se réserve la faculté de prendre toutes les décisions liées à la détermination de la politique et des objectifs d'investissement, à toute modification de la stratégie d'investissement, à la conclusion de tout contrat important, au remplacement de tout membre du conseil, de tout auditeur externe, à la défense judiciaire ou au règlement de tout litige important pour la Société et à toute évolution majeure des politiques ou pratiques comptables. En outre, le Conseil approuve le prospectus et tout addendum à ce dernier, toute circulaire aux actionnaires, tout état financier de même que toute autre documentation légale concernée.

La principale responsabilité du Président est de diriger et de gérer le Conseil, d'encourager les discussions critiques et de favoriser une communication efficace au sein du Conseil. Ils sont également chargés de promouvoir les bonnes pratiques, la gouvernance d'entreprise et une communication efficace avec les actionnaires.

Les Administrateurs bénéficient, en cas de besoin, des conseils et des services d'un conseiller externe et du personnel du BlackRock Group ainsi que de BlackRock (Luxembourg) S.A. (la « Société de Gestion »). Si nécessaire, dans l'exercice de leurs fonctions, le Conseil et chaque Administrateur peuvent demander l'avis d'un professionnel indépendant. Le Conseil est

Rapport des Administrateurs suite

responsable de veiller à ce que les registres comptables de la Société soient dûment tenus, lesquels doivent faire apparaître à tout moment, avec une précision raisonnable, la situation financière de la Société et permettre au Conseil de s'assurer que les états financiers sont conformes aux normes comptables concernées. Le Conseil est chargé de présenter une évaluation équilibrée et compréhensible de la situation financière de la Société, comprenant les états financiers intermédiaires et autres rapports mis à la disposition des actionnaires et du public. Le Conseil est chargé de prendre des mesures raisonnables pour la sauvegarde des actifs de la Société et pour la prévention et la détection des fraudes et autres irrégularités.

Assurance

La Société souscrit une assurance couvrant de manière appropriée la responsabilité des Administrateurs et des cadres.

Délégation des responsabilités

La Société étant une société d'investissement à capital variable, la plupart de ses activités journalières de gestion et d'administration sont déléguées à des sociétés de BlackRock Group comme la Société de Gestion, qui emploie des professionnels spécialisés dans la conformité et le risque. La Société de Gestion nomme les Gestionnaires Financiers par délégation et d'autres prestataires de services tiers. Le Conseil a délégué les domaines de responsabilités suivants :

Gestion et administration

Le Conseil a délégué la gestion des investissements, l'administration, le marketing et la distribution de la Société et de ses Compartiments à la Société de Gestion. La Société a nommé The Bank of New York Mellon SA/ NV, succursale luxembourgeoise (« BNYM ») comme Dépositaire de ses actifs, avec pour responsabilité la garde de ces actifs, conformément aux réglementations. Le Dépositaire est une filiale de The Bank of New York Mellon Corporation.

La Société de Gestion a délégué la gestion du portefeuille de titres aux Gestionnaires Financiers par délégation. Les Gestionnaires Financiers par délégation observent les lignes directrices déterminées par le Conseil et indiquées dans le prospectus de la Société portant sur les Fonds de cette dernière. Les Gestionnaires Financiers par délégation concernés sont directement responsables des décisions concernant la gestion quotidienne des Compartiments de la Société et répondent de la performance des investissements des Compartiments vis-à-vis de la Société de Gestion. Le Conseil a également délégué l'exercice des droits de vote attachés aux titres détenus dans le portefeuille aux Gestionnaires Financiers par délégation respectifs, qui peuvent à leur tour le déléguer à BIM UK. Le vote pour le compte d'actionnaires s'effectue de manière à servir au mieux les intérêts économiques des actionnaires en tant qu'investisseurs à long terme.

La Société de Gestion a délégué ses responsabilités relatives aux services administratifs de la Société et de ses Compartiments à The Bank of New York Mellon SA/ NV, succursale de Luxembourg (l'« Agent administratif »). L'Agent administratif est responsable de l'administration des affaires de la Société, y compris le calcul de la valeur liquidative et la préparation des états financiers de la Société, sous réserve

de la supervision générale de la Société de Gestion. L'Agent administratif est une filiale de The Bank of New York Mellon Corporation. La Société de Gestion a délégué les services d'agent de transfert et d'enregistrement des actions à J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.

La Société de Gestion a délégué la distribution, la promotion et la commercialisation des Actions, ainsi que l'administration et la commercialisation connexes courantes à BIM UK en tant que Distributeur principal. En tant que Distributeur principal, BIM UK est responsable de l'offre de vente, de la promotion et de la commercialisation des actions de tout compartiment. BIM UK est responsable envers la Société de Gestion de la distribution et de la commercialisation des Actions.

La Société de Gestion est responsable envers le Conseil de toutes les activités qui lui sont déléguées ou qu'elle délègue, y compris, entre autres, celles décrites ci-dessus.

La Société de Gestion présente un rapport au Conseil tous les trimestres et, au besoin et à titre exceptionnel, de manière ponctuelle. Les rapports sont produits afin de veiller à ce que le Conseil puisse superviser efficacement les mesures prises par ses délégués.

La Société de Gestion est responsable de la gestion des risques et des contrôles internes de la Société, ainsi que de la vérification de leur efficacité, de manière à veiller à ce que les informations financières publiées ou utilisées dans le cadre de l'activité soient fiables, et à surveiller régulièrement la conformité aux réglementations régissant le fonctionnement de la Société. La Société de Gestion vérifie, en continu, l'efficacité des systèmes de gestion des contrôles internes et des risques, afin d'identifier, d'évaluer et de gérer les risques importants de la Société. Ce processus comprend des procédures conçues pour détecter et évaluer tout(e) défaut ou faiblesse. Si le Conseil considère une affaire comme importante, il existe des procédures visant à assurer que les mesures nécessaires sont prises pour remédier aux défauts.

Les processus de contrôle des risques identifiés, couvrant la gestion des finances, des opérations, de la conformité et des risques, font partie intégrante des opérations de BlackRock Group et de la Société de Gestion. Un processus de surveillance et de transmission de rapports, mené par le service d'audit d'entreprise de BlackRock dans le but d'analyser ces contrôles, était en vigueur durant la période examinée et jusqu'à la date du présent rapport.

Les unités de BlackRock chargées de la gestion des risques d'audit et du risque opérationnel présentent, sur une base trimestrielle, un rapport à la Société de Gestion. La Société de Gestion reçoit également, de la part de l'Agent administratif et du Dépositaire, un rapport sur les contrôles internes des activités de garde et des activités administratives de la Société. Le Conseil reconnaît que ces systèmes de contrôle peuvent uniquement gérer et non éliminer les risques de non-réalisation des objectifs des fonds et qu'ils peuvent garantir de manière raisonnable mais non absolue contre toute anomalie ou perte importante ; ledit Conseil s'appuie sur les contrôles opérationnels mis en place par les prestataires de services.

Rapport des Administrateurs suite

Rapports financiers

Le Conseil est également responsable de l'établissement et du bon fonctionnement des systèmes de gestion des contrôles internes et des risques de la Société, en relation avec le processus de production de rapports financiers. Ces systèmes sont conçus pour gérer et non pour éliminer le risque de non-réalisation des objectifs de la Société s'agissant de la production de rapports financiers. La Société dispose de procédures visant à garantir la bonne tenue et l'accessibilité de tous les registres comptables concernés et, notamment, la production des états financiers annuels et semestriels. Ces procédures comprennent la désignation de l'Agent administratif pour la tenue des registres comptables de la Société, indépendamment du Gestionnaire d'Investissement par délégation et du Dépositaire. Les états financiers sont préparés conformément au droit applicable et aux principes comptables généralement reconnus, et sont approuvés par le Conseil d'administration de la Société. Les données comptables communiquées dans le rapport annuel doivent être révisées et le rapport du commissaire aux comptes agréé, y compris toute réserve, est entièrement reproduit dans le rapport annuel de la Société.

Rémunération

La Société est une société d'investissement et ne possède aucun employé ni aucun Administrateur exécutif. Aucun Administrateur (ancien ou actuel) n'a droit à une quelconque prestation de retraite de la part de la Société, et la Société n'a attribué aucune option sur actions ou prime de rendement à long terme. Aucun élément de rémunération des Administrateurs n'est lié au rendement. Les Administrateurs qui sont également des employés de BlackRock Group n'ont droit à aucune rémunération en tant qu'Administrateur (jeton). Tous les autres Administrateurs reçoivent une rémunération soumise à l'approbation des actionnaires lors de l'assemblée générale annuelle et communiquée à la page 992. Le Conseil estime que le niveau de rémunération des Administrateurs qui perçoivent une commission correspond au temps consacré à cette fonction et aux responsabilités y afférentes. Le Conseil estime que les commissions sont justes et appropriées compte tenu de la taille, de la complexité et de la gamme des compartiments sous gestion. Le montant maximal de rémunération payable aux Administrateurs est approuvé par le Conseil.

Communication avec les actionnaires

Le Conseil est responsable de la convocation à l'assemblée générale annuelle et à toutes les autres assemblées générales de la Société. Les actionnaires sont encouragés à participer et voter aux assemblées générales. L'avis de convocation aux assemblées générales est émis conformément aux statuts de la Société et l'avis de convocation à l'assemblée générale annuelle est envoyé au moins 8 jours avant l'assemblée. Toutes les questions de fond portées devant l'assemblée générale sont traitées au moyen d'une résolution distincte. Les chiffres des votes par procuration sont notés par la présidente de l'assemblée générale.

La prochaine Assemblée générale annuelle des Actionnaires se tiendra le 16 février 2024 ou aux alentours de cette date et les actionnaires seront invités à examiner les points habituellement abordés lors de ces assemblées, notamment :

- ▶ Approbation des états financiers et paiement des dividendes
- ▶ Approbation des commissions des Administrateurs
- ▶ Élection ou réélection des Administrateurs
- ▶ Élection ou réélection du commissaire aux comptes
- ▶ Quitus aux Administrateurs – cette résolution est requise par la loi luxembourgeoise et le quitus n'est valable que si les états financiers ne contiennent pas d'omission ou de fausses informations qui masquent la situation financière réelle de la Société. Le quitus est accordé sur la base des faits divulgués et des informations mises à la disposition des actionnaires lors de l'Assemblée générale annuelle.

Les procédures relatives aux assemblées générales sont régies par les statuts de la Société.

En tant que Distributeur principal, BIM UK est chargé de gérer la relation entre la Société et ses actionnaires, et le Conseil a mis en place des contrôles lui permettant d'être informé des plaintes des actionnaires.

Parcours professionnels des Administrateurs

Denise Voss (Présidente) (de nationalité américaine, résidant au Luxembourg) : Mme Voss est un administrateur non exécutif de sociétés de services financiers et exerce ses activités à Luxembourg. Elle siège comme Administratrice aux Conseils d'administration de fonds phare de grands promoteurs de fonds, y compris BlackRock Global Funds et BlackRock Strategic Funds. Mme Voss a travaillé auparavant pour Franklin Templeton au Luxembourg pendant plus de 25 ans en tant que Dirigeante et Administratrice des activités OPCVM et de gestion de fonds d'investissement alternatifs de la société. Avant de rejoindre Franklin Templeton, elle a travaillé 10 ans chez Coopers & Lybrand à Boston, aux États-Unis et au Luxembourg. Elle est titulaire d'une licence CPA Massachusetts et a obtenu un diplôme de premier cycle à l'Université Tufts, ainsi qu'un diplôme de Master en comptabilité de l'Université de Bentley. Mme Voss est présidente de LuxFLAG, une agence indépendante dont le siège est situé au Luxembourg, qui décerne des labels reconnus de finance durable aux structures d'investissement éligibles. De 2015 à 2019, elle a été présidente de l'ALFI (Association luxembourgeoise des fonds d'investissement), et de 2007 à 2019, membre du Conseil d'administration de l'ALFI.

Paul Freeman (de nationalité britannique) : M. Freeman est un Administrateur non exécutif qui possède plus de 40 ans d'expérience dans le secteur de la gestion des investissements. Il siège actuellement aux conseils d'administration d'un certain nombre de fonds d'investissement domiciliés au Luxembourg et dans les îles Caïmans. Jusqu'en avril 2022, il a été Administrateur non exécutif de plusieurs filiales du groupe BlackRock en Irlande, notamment de sa société de gestion d'OPCVM/AIFM pour laquelle il a également été président du Comité d'investissement. Jusqu'en décembre 2015, il occupait le poste de Managing Director de BlackRock (ayant rejoint le groupe en août 2005). Entre juillet 2011 et décembre 2015, M. Freeman a travaillé en étroite collaboration avec l'équipe

Rapport des Administrateurs suite

des affaires gouvernementales de BlackRock et a participé à différents comités de gouvernance internes. Jusqu'en juillet 2011, il était Directeur du développement des produits et de la Gestion de la gamme pour la région EMEA, avec pour responsabilité le développement et la gestion continue des produits de tous les fonds domiciliés dans la région EMEA et distribués sur une base transfrontalière par BlackRock. Avant de rejoindre BlackRock, M. Freeman a occupé des postes de direction chez Schroders, Rothschild Asset Management, Henderson Investors et GT Management (qui fait désormais partie d'Invesco). M. Freeman est expert-comptable.

Bettina Mazzocchi (de nationalités britannique, française et italienne) : Mme Mazzocchi est Managing Director chez BlackRock et exerce ses activités à Paris. Elle est responsable d'iShares et Wealth pour la France, la Belgique, le Luxembourg et Monaco. Avant de rejoindre BlackRock en 2018, elle travaillait chez PIMCO depuis 2008, où elle occupait le poste de Directrice pays pour la France. Mme Mazzocchi a précédemment travaillé chez Morgan Stanley, Bank of America et Credit Suisse First Boston, où ses fonctions l'amenaient à se concentrer sur les marchés des instruments dérivés de crédit, des crédits structurés et des capitaux d'emprunt. Mme Mazzocchi est membre du Conseil d'administration du YATI (Young Actors Theatre Islington), une compagnie de théâtre communautaire à but non lucratif pour les enfants et les jeunes à Londres, au Royaume-Uni. Mme Mazzocchi est diplômée de l'Institut d'Études Politiques de Paris (« Sciences Po ») et de l'Université Paris III Sorbonne Nouvelle.

Geoffrey D. Radcliffe (double nationalité britannique et luxembourgeoise, résident luxembourgeois) : M. Radcliffe est Managing Director chez BlackRock et exerce ses activités à Luxembourg. Il est membre de l'équipe chargée des services internationaux Comptabilité et Produits de BlackRock Business Operations & Technology, et est responsable de la surveillance des produits et de la gouvernance internationale pour BlackRock EMEA & Asia Pacific. M. Radcliffe est Membre de l'Institute of Chartered Accountants d'Angleterre et du Pays de Galles ainsi que du Chartered Institute of Bankers. Après plus de 40 années d'expérience dans les fonds communs de placement, la comptabilité et les services bancaires acquise au Luxembourg, aux Bermudes, à Londres et à l'île de Man, M. Radcliffe a rejoint le BlackRock Group en 1998. Il siège aux conseils de BlackRock Luxembourg S.A. et BlackRock Fund Management Company S.A., ainsi qu'aux conseils de plusieurs sociétés et fonds d'investissement du BlackRock Group. Il a été membre du conseil d'administration de l'ALFI (Association luxembourgeoise des fonds d'investissement) pendant 10 ans jusqu'en juin 2023. Il continue actuellement à diriger et à faire partie de groupes de travail clés de l'ALFI.

Davina Saint (de nationalité britannique, résidente irlandaise) : basée à Dublin, Mme Saint est Administratrice non exécutive de sociétés de services financiers et Administratrice de l'Irish National Assets Management Agency, siégeant au Conseil d'administration, aux Comités de crédit et de planification et présidant le Comité de rémunération. Mme Saint a travaillé pour le Groupe BNP Paribas pendant plus de 20 ans en tant que General Counsel pour ses activités bancaires

dédiées aux entreprises et aux institutions irlandaises et, dernièrement, en tant que Head of Branch pour l'activité Irish Securities Services de BNP Paribas. Avant de rejoindre BNP Paribas, elle a travaillé à la City de Londres chez ABN Amro après avoir obtenu son diplôme de Solicitor (Avocat-conseil) dans le domaine du contentieux maritime. Elle est titulaire d'un diplôme spécialisé en droit obtenu à la London School of Economics. Elle est également Chartered Director (CDir) et Certified Bank Director.

Keith Saldanha (de nationalité britannique) : M. Saldanha est Managing Director de BlackRock et Directeur du Wealth Product Group pour l'Europe, le Moyen-Orient et l'Afrique. Il est responsable du processus de définition et d'exécution des plans pour les produits alpha et alternatifs de l'activité BlackRock EMEA Wealth. Par ailleurs, M. Saldanha dirige le segment Fund Selection and Manager Research pour l'organisation des ventes EMEA iShares & Wealth. Il est membre du Comité exécutif Wealth EMEA, du Comité de développement des produits EMEA et du Comité de gestion des capacités EMEA. Il a rejoint BlackRock en 2015 après avoir quitté Man Group, où il était Global Head of Investment Marketing, responsable de plusieurs équipes de spécialistes produits, de développement commercial et de service à la clientèle pour les activités de gestion des investissements de Man. Auparavant, il a consacré plusieurs années à la création et l'exécution de l'activité de fusions et acquisitions de fonds spéculatifs de Man, tout en dirigeant la stratégie d'entreprise pour l'activité de fonds spéculatifs. M. Saldanha a commencé sa carrière dans le conseil en stratégie. Il est analyste en placements alternatifs agréé et est titulaire d'un BSc (Hons) en Économie obtenu à l'Université de Warwick.

Vasiliki Pachatouridi (double nationalité britannique et grecque) : Mme Pachatouridi est Managing Director, responsable d'iShares Fixed Income Product Strategy EMEA au sein du BlackRock Indexed Fixed Income Portfolio Management Group (PMG). Elle est chargée d'encourager l'adoption d'ETF d'iShares à revenu fixe et d'autres stratégies indicelles à revenu fixe, tant sur le plan institutionnel que sur le plan patrimonial. Mme Pachatouridi représente également l'entreprise face à la clientèle, aux organismes de réglementation, aux organismes professionnels et aux médias, préconisant la nécessité de moderniser les marchés obligataires, notamment en ce qui concerne la négociation, la liquidité et l'évolution des indices. Mme Pachatouridi travaille pour l'entreprise depuis 2007, si l'on tient compte des années passées chez Barclays Global Investors (BGI), qui a fusionné avec BlackRock en 2009. Auparavant, elle était membre de l'équipe iShares EMEA Investment Strategies & Insights, où elle fournissait des analyses sur les produits ETF, ainsi que des opinions sur des opérations de placement et des informations sur le marché à divers clients. Chez BGI, elle a commencé sa carrière au sein de l'équipe Transition Management. Mme Pachatouridi est titulaire d'un MSc (Master) en Gestion des investissements obtenu avec mention très bien à la Cass Business School en 2007 et d'un BSc (Bachelor/Licence) en Administration des affaires obtenu à l'université de Bath en 2006.

Rapport sur les rémunérations (non révisé)

Les informations ci-dessous concernent les politiques de rémunération du BlackRock Group (« BlackRock »), telles qu'elles s'appliquent à BlackRock (Luxembourg) S.A. (la « ManCo »). Les informations sont transmises conformément à la Directive 2009/65/CE portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant les organismes de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM »), telle que modifiée, notamment la Directive 2014/91/UE du Parlement européen et du Conseil du 23 juillet 2014, (la « Directive »), et aux « Lignes directrices dans le cadre des Directives OPCVM et AIFM » émises par l'Autorité européenne des marchés financiers.

Chez BlackRock, la politique de rémunération applicable aux OPCVM (la « Politique de rémunération applicable aux OPCVM ») sera applicable aux entités de l'EEE, au sein du BlackRock Group, agréées en tant que gestionnaires d'OPCVM conformément à la Directive, et assurera la conformité aux exigences de l'Article 14b de la Directive, et aux entités britanniques du BlackRock Group autorisées par la FCA en tant que gestionnaires d'un fonds OPCVM britannique.

La ManCo a adopté la Politique de Rémunération applicable aux OPCVM, résumée ci-dessous.

Gouvernance en matière de rémunération

La gouvernance de BlackRock en matière de rémunération dans la région EMEA s'articule en une structure à plusieurs niveaux comprenant : (a) le Comité de gestion, de développement et de rémunération (« CGDR ») (qui est le comité de rémunération indépendant et mondial de BlackRock, Inc.) et (b) le conseil d'administration de la ManCo (le « Conseil de la ManCo »). Ces organismes ont pour tâche de déterminer les politiques de rémunération de BlackRock, dont la révision régulière de la politique de rémunération et la responsabilité de sa mise en œuvre.

La mise en œuvre de la politique de rémunération fait chaque année l'objet d'une révision centrale et indépendante à des fins de conformité aux politiques et aux procédures de rémunération adoptées par le CGDR et par le Conseil de la ManCo. Aucun problème fondamental n'a été détecté lors de la dernière révision. Les informations relatives à la rémunération sont générées et détenues par le CGDR et le Conseil d'administration du Gestionnaire.

Aucun changement important n'a été apporté à la politique de rémunération en 2022.

(a) Le CGDR

Le principal objectif du CGDR est de :

- ▶ fournir un aperçu :
 - ▶ des programmes de rémunération des dirigeants de BlackRock ;
 - ▶ les systèmes d'indemnités des employés de BlackRock ; et
 - ▶ des autres systèmes de rémunération qui peuvent être établis, le cas échéant, par BlackRock et dont le CGDR est réputé être l'agent administratif ;

- ▶ examiner et discuter, conjointement avec la direction, de l'analyse des rémunérations figurant dans la circulaire annuelle de sollicitation de procurations (proxy statement) de BlackRock, Inc., et approuver le rapport du CGDR pour une intégration dans la circulaire de sollicitation des procurations ;
- ▶ examiner, évaluer et présenter des rapports et des recommandations au Conseil d'administration de BlackRock, Inc. (le « Conseil de BlackRock Inc. »), le cas échéant, sur le développement de talents et la planification de la relève de BlackRock, en mettant l'accent sur la performance et la relève aux plus hauts niveaux de la direction ; et
- ▶ aider les conseils d'administration des entités de la Société réglementées EMEA à s'acquitter de leurs obligations en matière de rémunération en supervisant la conception et la mise en œuvre de la politique de rémunération EMEA conformément aux réglementations applicables.

Le CGDR conserve son propre conseiller indépendant en matière de rémunération, Semler Brossy Consulting Group LLC, qui n'a aucun lien avec BlackRock, Inc. ou avec le Conseil de BlackRock, Inc. pouvant interférer avec sa faculté de fournir des conseils de façon indépendante au CGDR sur les questions liées à la rémunération.

Le Conseil de BlackRock, Inc. a décrété que tous les membres du CGDR doivent être « indépendants » au sens des normes d'inscription à la cote de la Bourse des valeurs de New York (NYSE), laquelle exige que chacun d'entre eux soit en conformité avec une norme d'« administrateur non-salarié ».

Le CGDR s'est réuni 7 fois en 2022. La charte du CGDR peut être consultée sur le site Internet de BlackRock, Inc. (www.blackrock.com).

Par suite de ses examens réguliers, le CGDR demeure satisfait des principes de la politique et de l'approche de BlackRock en matière de rémunération.

(b) Le Conseil de la ManCo

Le Conseil de la ManCo a pour tâche de superviser et de surveiller la politique de rémunération de l'OPCVM telle qu'appliquée à la ManCo et à son Personnel identifié.

Processus de prise de décision

Les décisions relatives à la rémunération des employés sont prises une fois par an, en janvier, après la clôture de l'exercice. Ce calendrier permet de prendre en considération les résultats financiers de la totalité de l'exercice ainsi que les autres objectifs non financiers. Bien que le cadre dans lequel les décisions relatives aux rémunérations sont prises soit lié à la performance financière, les rémunérations individuelles variables sont fixées avec discernement sur la base de l'obtention de résultats stratégiques et opérationnels et autres considérations comme les capacités de gestion et de leadership.

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

Aucune formule n'est établie et aucune donnée de référence n'est utilisée dans la détermination des primes annuelles. Pour déterminer certains montants de rémunération individuelle spécifiques, plusieurs facteurs sont pris en considération, notamment les objectifs non financiers, la performance financière générale et la performance en matière d'investissement. Ces résultats sont étudiés dans leur ensemble, sans pondération particulière, et il n'existe aucun lien direct entre une mesure de performance donnée et la prime annuelle qui en découle. La rémunération variable attribuée à une ou plusieurs personnes physiques pour la performance d'une année en particulier peut aussi être égale à zéro.

Les primes annuelles versées sont prélevées sur une somme globale affectée aux primes (bonus pool).

Le montant de la somme globale prévue, comprenant les primes en liquidités et les primes en actions, est revu tout au long de l'année par le CGDR, et la somme globale définitive est approuvée après la clôture de l'exercice. Dans le cadre de cette révision, le CGDR reçoit des données financières réelles et prévisionnelles tout au long de l'exercice, ainsi que des données finales de clôture. Les données financières que le CGDR reçoit et examine comprennent le compte de résultat prévisionnel et autres mesures financières, en comparaison avec l'exercice précédent et le budget de l'exercice en cours. Le CGDR examine d'autres mesures de la performance financière de BlackRock (par exemple les entrées nettes d'ASG et la performance des investissements), de même que les données concernant les conditions du marché et les niveaux de rémunération concurrentiels.

Le CGDR examine régulièrement les recommandations de la direction s'agissant du pourcentage de résultat d'exploitation avant primes qui sera cumulé et comptabilisé en tant que charge de rémunération tout au long de l'exercice, pour la partie liquide de la somme globale annuelle affectée aux primes (le « taux d'accumulation »). Le taux d'accumulation de la partie liquide de la somme globale annuelle affectée aux primes peut être modifié par le CGDR en cours d'exercice, sur la base de son examen des données financières indiquées ci-dessus. Le CGDR n'applique aucune pondération particulière ni aucune formule aux données qu'il examine lors de la détermination du montant de la somme globale affectée aux primes ou des sommes cumulées pour la partie liquide de la somme globale affectée aux primes.

Après la clôture de l'exercice, le CGDR approuve le montant de la somme globale affectée aux primes.

Dans le cadre du processus d'examen de clôture d'exercice, les services chargés du risque d'entreprise et de la conformité aux réglementations présentent au CGDR un rapport sur les activités, les incidents ou les événements qui méritent d'être pris en considération dans les décisions prises en matière de rémunération.

Les personnes concernées ne participent pas à l'établissement de leur propre rémunération.

Fonctions de contrôle

Chacune des fonctions de contrôle (risque d'entreprise, affaires juridiques et conformité, et audit interne) possède sa propre structure, laquelle est indépendante des unités d'entreprise. Les membres du personnel des fonctions de contrôle sont donc rémunérés indépendamment des activités qu'ils supervisent. La personne responsable de chaque fonction de contrôle est soit un membre du comité exécutif international, le comité de gestion international, soit tenu de présenter un rapport au conseil d'administration de BlackRock Group Limited, la société mère de toutes les entités réglementées de BlackRock dans la région EMEA, y compris la ManCo.

Les sommes globales affectées aux primes pour chaque fonction sont déterminées en référence à la performance de chacune des fonctions. La rémunération des cadres supérieurs des fonctions de contrôle est directement supervisée par le CGDR.

Lien entre la paye et la performance

Une philosophie de rétribution au rendement de même que des programmes de rémunération clairs et bien définis ont été conçus pour atteindre les objectifs clés suivants, décrits ci-dessous :

- ▶ équilibrer les résultats financiers de BlackRock de façon appropriée entre les actionnaires et les employés ;
- ▶ attirer, fidéliser et motiver les employés capables de contribuer de manière significative à la réussite de l'entreprise à long terme ;
- ▶ aligner les intérêts des cadres supérieurs sur ceux des actionnaires en attribuant des actions de BlackRock, Inc. comme part importante des primes annuelles et à long terme ;
- ▶ contrôler les coûts fixes en veillant à ce que les frais de rémunération varient en fonction de la rentabilité ;
- ▶ lier une part importante de la rémunération totale d'un employé à la performance financière et opérationnelle de l'entreprise ;
- ▶ promouvoir une gestion saine et efficace des risques dans toutes les catégories de risques, y compris les risques liés au développement durable ;
- ▶ décourager la prise de risque excessive (liée à la durabilité ou autre) ; et
- ▶ veiller à ce que les intérêts des clients ne soient pas défavorablement touchés par la rémunération attribuée à court, moyen et/ou long terme.

Pour instaurer une culture du haut rendement, il faut être en mesure d'évaluer les performances par rapport à des objectifs, des valeurs et des comportements, de façon claire et cohérente. Les managers utilisent une échelle de notation à 5 points pour l'évaluation générale de la performance d'un employé ; en outre,

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

les employés fournissent une autoévaluation. La note générale finale fait l'objet d'un rapprochement lors de chaque évaluation de la performance d'un employé. Les employés sont évalués par rapport à la façon dont l'objectif est atteint et par rapport à la performance absolue en elle-même.

Dans le respect de la philosophie de rémunération au rendement, les notes sont utilisées pour différencier et récompenser une performance individuelle – mais ne servent pas à préétablir les rémunérations. Les décisions relatives aux rémunérations demeurent discrétionnaires et sont prises dans le cadre du processus de rémunération de fin d'exercice.

Lorsque les niveaux de rémunération sont fixés, d'autres facteurs sont pris en considération, outre la performance individuelle, parmi lesquels :

- ▶ la performance du Gestionnaire, les fonds gérés par le Gestionnaire et/ou le service concerné de la fonction ;
- ▶ des facteurs concernant un employé de façon individuelle ; les relations avec les clients et les collègues ; le travail en équipe ; les compétences ; et les problèmes de conduite ; et, sous réserve de toute politique applicable, l'impact que tout congé autorisé peut avoir sur la contribution à l'entreprise) ;
- ▶ la gestion du risque dans le cadre de profils de risque appropriés pour les clients de BlackRock ;
- ▶ les besoins stratégiques de l'entreprise, y compris ses intentions en matière de fidélisation ;
- ▶ la compréhension des marchés ;
- ▶ la criticité pour l'entreprise ; et
- ▶ le soutien des approches de l'entreprise en matière de facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance, ainsi que de diversité, d'équité et d'inclusion.

Un outil essentiel est la gestion des risques et, lorsque les employés sont rémunérés pour une excellente performance dans leur gestion des actifs des clients, il leur est demandé de gérer le risque dans le cadre des profils de risque appropriés pour leurs clients. Par conséquent, les employés ne sont pas récompensés pour avoir engagé des transactions en dehors de paramètres établis. Les pratiques de rémunération ne prévoient pas de primes indues pour la planification à court terme ou pour les bénéfices financiers à court terme, ne récompensent pas le risque déraisonnable et offrent un équilibre raisonnable entre les différents risques substantiels inhérents à l'activité de gestion d'investissements, de gestion des risques et de services de conseil.

BlackRock utilise un modèle de rémunération globale qui comprend un salaire de base, lequel est contractuel, et un régime de primes discrétionnaires.

BlackRock utilise un régime de primes discrétionnaires annuelles. Bien que les employés puissent avoir droit à une prime discrétionnaire, aucune obligation contractuelle n'impose d'octroyer une prime à un employé en vertu de son régime de primes discrétionnaires. Lors de l'attribution d'une prime discrétionnaire, les facteurs indiqués ci-dessus (sous le titre « Lien entre la paye et la performance ») peuvent être pris en compte en plus des autres questions connexes à l'exercice de ce pouvoir discrétionnaire au cours de l'année concernée.

L'attribution de primes discrétionnaires à tous les employés, y compris les dirigeants, est soumise aux lignes directrices qui déterminent la part payée en liquide et la part payée en actions BlackRock, Inc., de même qu'aux autres conditions de dévolution et de récupération (clawback). L'attribution d'actions est soumise à un ajustement ultérieur de la performance, par le biais d'une variation du prix de l'action de BlackRock, Inc. durant la période d'indisponibilité. Lorsque la rémunération annuelle totale augmente, une part plus importante est dévolue en actions. Le CGDR a adopté cette approche en 2006, pour faire croître substantiellement la valeur pour l'entreprise et l'alignement du régime de rémunération sur les actionnaires pour les employés éligibles, y compris les dirigeants. La part en actions est dévolue en trois versements égaux durant les trois années suivant l'attribution.

Outre la prime discrétionnaire annuelle décrite ci-dessus, des attributions d'actions peuvent être accordées pour sélectionner des individus afin d'assurer un meilleur lien avec les résultats futurs de l'entreprise. Ces attributions de primes à long terme ont été établies individuellement, afin d'offrir une incitation significative pour une performance constante sur plusieurs années en reconnaissance de la portée du travail de l'individu, de ses compétences professionnelles et de ses aptitudes au leadership.

Dans le cadre du « Système de primes au rendement de BlackRock » (« SPRB ») certains cadres dirigeants peuvent recevoir des primes ajustées au rendement sous forme d'actions. Les primes du SPRB couvrent une période de performance de trois ans, sur la base d'une évaluation de la Marge d'exploitation ajustée⁽¹⁾ et Croissance organique⁽²⁾. Le versement sera déterminé en fonction des résultats de l'entreprise par rapport aux résultats financiers cibles, à la fin de l'exercice. Le maximum d'actions pouvant être accordées est de 165 % de la prime, lorsque les deux paramètres atteignent les objectifs financiers préalablement fixés. Aucune action ne peut être accordée si les résultats de l'entreprise, pour les deux paramètres ci-dessus, sont inférieurs à un seuil de performance préétabli. Ces paramètres ont été choisis comme mesures clés de la valeur pour l'actionnaire, qui perdurent tout au long des différents cycles du marché.

Un nombre limité de professionnels de l'investissement se voient attribuer une partie de leurs primes annuelles discrétionnaires (comme indiqué ci-dessus) en liquidités différées qui suivent théoriquement l'évolution des investissements dans des produits choisis gérés par l'employé.

⁽¹⁾ Marge d'exploitation ajustée : Comme indiqué dans les déclarations externes de BlackRock, ce terme désigne le Revenu d'exploitation ajusté divisé par le Chiffre d'affaires total hors frais de distribution, dépenses courantes et amortissement des commissions de vente différées.

⁽²⁾ Croissance organique : égale aux nouvelles commissions de base nettes plus le nouveau chiffre d'affaires Aladdin net généré au cours de l'exercice (en dollars US).

Rapport sur les rémunérations (non révisé) suite

Ces primes ont pour but d'aligner les professionnels de l'investissement sur les rendements des produits qu'ils gèrent, au moyen de la rémunération différée s'agissant de ces produits. De plus en plus, les clients et les évaluateurs externes voient d'un œil favorable les produits avec lesquels les investisseurs clés « risquent leur peau », c'est-à-dire dans lesquels ils ont des intérêts propres significatifs en jeu.

Personnel identifié

La Politique de rémunération applicable aux OPCVM fixe le processus qui sera mis en œuvre pour identifier le personnel en tant que « Personnel identifié », à savoir les catégories de personnel de la ManCo, comprenant la haute direction, les preneurs de risque, les fonctions de contrôle et tout employé recevant une rémunération totale qui le place dans la même catégorie de rémunération que la haute direction et les preneurs de risque, dont les activités professionnelles ont un impact important sur les profils de risque de la ManCo ou des compartiments qu'elle gère.

La liste des membres du Personnel identifié sera régulièrement révisée, une révision officielle étant effectuée, mais de façon non limitative, dans les circonstances suivantes :

- ▶ changements organisationnels ;
- ▶ nouvelles initiatives de l'entreprise ;
- ▶ changements dans les listes des fonctions dont l'influence est significative ;
- ▶ changements des responsabilités attribuées aux différents postes ; et
- ▶ révision de l'orientation réglementaire.

Informations quantitatives relatives à la rémunération

La ManCo est tenue, en vertu de la Directive, de faire des divulgations quantitatives sur la rémunération. De telles communications sont faites conformément à l'interprétation de BlackRock des orientations réglementaires actuellement disponibles en matière d'informations quantitatives sur la rémunération. En fonction de l'évolution des pratiques des marchés ou des pratiques réglementaires, BlackRock peut juger approprié de modifier la façon dont les informations quantitatives sur la rémunération sont calculées. Lorsque de telles modifications sont apportées, il est possible que les informations relatives à un compartiment ne soient pas comparables à celles communiquées l'année précédente, ou à celles d'autres compartiments BlackRock au cours de cette même année.

Des informations sont communiquées concernant (a) le personnel de la ManCo ; (b) le personnel de la haute direction ; et (c) le personnel qui est en capacité d'affecter de façon importante le profil de risque du Fonds, y compris les individus à qui, bien qu'ils ne soient pas employés par la ManCo, leur employeur a confié la mission d'exécuter des services pour la ManCo.

Toutes les personnes physiques comprises dans les chiffres recueillis et communiqués sont rémunérées conformément à la politique de rémunération de BlackRock, pour leurs responsabilités dans le domaine d'activité concerné de BlackRock. Toutes les personnes physiques ayant plusieurs domaines de responsabilité, seule la partie de la rémunération pour les services de ces personnes attribuable à la ManCo est comprise dans les chiffres recueillis et communiqués.

Les membres du personnel et la haute direction de la ManCo fournissent habituellement des services OPCVM et non-OPCVM au niveau des compartiments multiples, des clients et des fonctions de la ManCo, ainsi qu'à l'échelle de tout le BlackRock Group. Inversement, les membres du personnel et la haute direction du groupe BlackRock au sens large peuvent fournir des services OPCVM et non-OPCVM au niveau des compartiments multiples, des clients et des fonctions du groupe BlackRock au sens large et de la ManCo. Par conséquent, les chiffres communiqués sont une somme de la part de rémunération de chaque personne physique attribuable à la ManCo, conformément à une méthode de répartition objective qui reconnaît la nature multi-services de la ManCo et du groupe BlackRock au sens large. Ainsi, les chiffres ne sont pas représentatifs de la rémunération réelle d'une quelconque personne physique ou de sa structure de rémunération.

Le montant de la rémunération totale versée au personnel de la ManCo au titre de l'exercice financier de la ManCo clos le 31 décembre 2022 s'élève à 257,2 millions d'USD. Ce chiffre est composé d'une rémunération fixe de 147,8 millions d'USD et d'une rémunération variable de 109,5 millions d'USD. Au total, la rémunération indiquée ci-dessus a été versée à 12 029 bénéficiaires.

Le montant de la rémunération globale versée par la ManCo à sa haute direction au titre de l'exercice financier de la ManCo clôturé le 31 décembre 2022, était de 6,7 millions d'USD, et celui attribué aux membres de son personnel dont l'action a un impact important sur le profil de risque de la ManCo ou de ses fonds était de 9,0 millions d'USD. Ces chiffres se rapportent à l'ensemble de la ManCo et non au Fonds.

Bilan

au 31 août 2023

Nom du Compartiment	Note	BlackRock Global Funds		Asia Pacific Equity Income Fund ⁽¹⁾		Asian Dragon Fund		Asian Growth Leaders Fund		Asian High Yield Bond Fund		Asian Multi-Asset Income Fund		Asian Sustainable Equity Fund		Asian Tiger Bond Fund		Brown To Green Materials Fund ⁽²⁾		China Bond Fund		China Flexible Equity Fund	
		USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	CNH	USD	USD
Actif																							
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		142.494.312.318		760.535.607	610.544.804	1.730.667.018	71.705.903	8.473.295	2.970.725.271	19.519.554	25.969.993.003	24.124.363											
Plus-values/(moins-values) non réalisées		8.380.196.414		(11.416.163)	(28.525.784)	(267.129.167)	(5.416.144)	(506.170)	(299.587.043)	297.262	(991.721.494)	(4.280.984)											
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	150.874.508.732		749.119.444	582.019.020	1.463.537.851	66.289.759	7.967.125	2.671.138.228	19.816.816	24.978.271.509	19.843.379											
Avoir en banque	2(a)	4.420.879.755	498.597	36.004.593	7.800.525	41.835.532	4.065.708	431.644	24.566.259	604.087	1.260.743.528	2.097.402											
Dus par le courtier	14	394.911.592					297.067		97.809.782		14.144.964												
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	743.197.906		153.332	82.279	22.498.798	471.424	7.450	29.673.940	7.180	359.785.765	12.210											
A recevoir sur placements vendus	2(a)	2.213.662.168		1.491.297	9.369.113	6.411.073	3.170.341		24.971.223			38.660											
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	296.937.160		296.981	44.331	1.649.359			333.658	10	413.195												
Plus-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	30.251.776				494.498	26.511		745.130														
Opérations de change à terme en cours	2(c)	34.759.767					9.863																
« Contracts for difference »	2(c)	3.163.511																					
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	1.067.596.102																					
Valeur de marché des swaps	2(c)	13.249.772																					
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	113.031.139				632.941	25.546		1.540.946		4.624.960												
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	65.351.353				15.258	21.171	940	22.051	488	524.799												
Total des actifs		160.271.500.733	498.597	787.065.647	599.315.268	1.537.075.310	74.377.390	8.407.159	2.850.938.692	20.428.581	26.618.508.720	21.991.651											
Passif																							
Sommes dues à la banque	2(a)	31.021.827			1				335.622														
Dus au courtier	14	82.427.836				270.712			3.440.000														
Distribution de revenu payable	2(a)	238.923.974		231.664	11.712	5.824.299	1.840		7.967.257		68.552.986												
Placements achetés à payer	2(a)	3.538.301.695				12.162.890	4.638.756		15.218.716		50.519.135												
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	341.291.512		902.014	6.338.750	2.314.885			24.000.921	20	112.931.853	11.998											
Moins-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	30.997.822																					
Opérations de change à terme en cours	2(c)	255.788.777		635.697	520.715	88.853			3.040.713		5.687.495												
« Contracts for difference »	2(c)	1.457.171		18.062							105.424.840												
Valeur de marché des swaps	2(c)	97.815.181					10.809																
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	102.336.467				121.387	66.535		345.473		465.344												
Autres charges	4,5,6,7,8	297.517.577	498.597	1.681.495	1.955.001	1.384.697	67.524	11.919	2.579.613	5.359	21.469.207	41.173											
Total du passif		5.017.879.839	498.597	3.468.932	8.826.179	22.167.723	4.785.464	11.919	56.928.315	5.379	365.050.860	120.813											
Total de l'actif net		155.253.620.894		783.596.715	590.489.089	1.514.907.587	69.591.926	8.395.240	2.794.010.377	20.423.202	26.253.457.860	21.870.838											

⁽¹⁾ Compartiment dissous au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	China Fund		China Impact Fund		China Innovation Fund		China Multi-Asset Fund ⁽²⁾		China Onshore Bond Fund ⁽²⁾		Circular Economy Fund		Climate Action Equity Fund		Climate Action Multi-Asset Fund		Continental European Flexible Fund		Developed Markets Sustainable Equity Fund		Dynamic High Income Fund	
		USD	USD	USD	USD	USD	USD	CNH	USD	USD	EUR	EUR	USD	USD	EUR	EUR	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	
Actif																							
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		1.070.958.326	29.782.766	18.392.833	19.219.783	679.481.236	1.525.824.595	4.602.858	45.560.878	4.035.167.660	15.535.022	2.868.877.904											
Plus-values/(moins-values) non réalisées		(64.675.346)	(5.843.213)	2.240.888	(666.504)	3.025.621	102.344.688	(243.524)	(1.784.182)	1.237.758.750	1.618.151	(136.826.863)											
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	1.006.282.980	23.939.553	20.633.721	18.553.279	682.506.857	1.628.169.283	4.359.334	43.776.696	5.272.926.410	17.153.173	2.722.051.041											
Avoir en banque	2(a)	34.246.439	1.919.006	146.109	708.995	64.406.166	50.049.402	251.632	1.886.249	126.161.290	140.926	151.994.796											
Dus par le courtier	14	660.000	-	-	164.000	-	-	-	-	1.090.000	-	-											
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	263.130	35.946	13.377	2.105	9.984.649	615.516	3.412	97.689	1.266.203	18.822	24.225.734											
A recevoir sur placements vendus	2(a)	1.937.201	-	599	-	-	-	-	-	22.966.617	-	4.061.003											
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	599.282	1.595	-	-	-	511.576	-	-	10.484.067	2.152	5.195.034											
Plus-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	79.736	192.788	-	-	14.404	-	-	3.778.439											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	-	-	-	3.220.390	-	-	-	7.471.896	-	-											
« Contrats for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	255.628											
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	49.848	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	-	-	-	-	122.957	-	-	63.422	-	-	1.043.669											
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	5.336	6	1.568	2.285	-	2.169.841	3.822	48.377	8.830.946	947	230.492											
Total des actifs		1.043.994.368	25.896.106	20.795.364	19.560.248	760.433.807	1.681.515.618	4.618.200	45.886.837	5.451.197.429	17.316.020	2.912.835.836											
Passif																							
Sommes dues à la banque	2(a)	9.388.154	-	-	-	-	-	-	-	17.618	-	-											
Dus au courtier	14	-	-	-	46.727	-	-	-	-	-	-	1.060.000											
Distribution de revenu payable	2(a)	14.957	-	-	76	69.356	80.337	-	16	9.232.822	-	16.309.571											
Placements achetés à payer	2(a)	4.295.297	-	-	-	-	2.090.521	45.724	118.055	106.196.825	-	46.932.206											
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	6.991.577	-	3.039	-	17.407	7.844.650	-	-	7.282.024	-	3.225.185											
Moins-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	1.259.172	36.251	453	61	-	6.423.247	-	164.320	-	2.022	7.316.723											
« Contrats for difference »	2(c)	212.231	-	-	-	-	-	-	-	1.078.310	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	-	-	-	-	12.616	-	-	10.116	-	-	326.000											
Autres charges	4,5,6,7,8	1.500.278	57.175	9.616	6.083	215.076	1.835.171	6.560	53.806	6.189.624	9.535	5.911.792											
Total du passif		23.661.666	93.426	13.108	52.947	314.455	18.273.926	52.284	346.313	129.997.223	11.557	81.081.477											
Total de l'actif net		1.020.332.702	25.802.680	20.782.256	19.507.301	760.119.352	1.663.241.692	4.565.916	45.540.524	5.321.200.206	17.304.463	2.831.754.359											

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Emerging Europe Fund ⁽³⁾		Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		Emerging Markets Equity Income Fund		Emerging Markets Impact Bond Fund		Emerging Markets Local Currency Bond Fund		Emerging Markets Sustainable Equity Fund		ESG Flex Choice Cautious Fund		ESG Flex Choice Growth Fund		ESG Flex Choice Moderate Fund	
		EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD
Actif																					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		559.462.949	1.136.628.825	815.874.350	207.001.338	2.477.955.952	91.685.739	1.723.069.595	78.619.495	9.970.692	12.027.721	13.121.750									
Plus-values/(moins-values) non réalisées		(327.185.990)	(243.430.729)	(44.150.888)	(10.848.959)	(197.210.866)	(7.644.711)	(143.283.080)	(4.578.690)	(143.118)	415.693	142.319									
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	232.276.959	893.198.096	771.723.462	196.152.379	2.280.745.096	84.041.028	1.579.786.515	74.040.805	9.827.574	12.443.414	13.264.069									
Avoir en banque	2(a)	33.450.085	84.825.575	5.871.799	9.995.707	232.779.733	7.926.884	21.756.933	5.070.503	27.402	19.737	23.247									
Dus par le courtier	14	-	404.000	-	-	2.470.000	-	5.358.351	-	-	-	-									
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	32.332.914	11.644.827	10.328.558	2.840.808	20.522.522	1.095.131	25.349.285	62.431	46	102	54									
A recevoir sur placements vendus	2(a)	23.287	-	-	40.107	8.394.141	-	-	-	-	-	82.662									
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	-	12.039.270	1.608.970	119.229	2.830.924	-	260.368	481.054	-	87.061	-									
Plus-value non réalisée sur:																					
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	135.647	232.414	-	-	-	273.882	-	-	4.214	2.734									
Opérations de change à terme en cours	2(c)	3.034	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-									
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	799.968	761.158	-	-	-	-	-	-									
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-									
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	1.734.743	256.730	-	-	-	3.488.690	-	-	-	-									
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	-	-	-	-	-	-	1.979.745	-	-	-	-									
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	653.592	1.813	86.391	19.309	274.975	-	2.157.548	37.031	4.918	3.969	1.911									
Total des actifs		298.739.871	1.003.983.971	790.108.324	209.967.507	2.548.778.549	93.063.043	1.640.411.317	79.691.824	9.859.940	12.558.497	13.374.677									
Passif																					
Sommes dues à la banque	2(a)	57.072	675	-	1.132.501	5.386.905	-	353.228	1.172.583	-	-	-									
Dus au courtier	14	-	1.961.116	360.000	-	2.010.000	-	5.227.089	-	-	-	-									
Distribution de revenu payable	2(a)	-	3.194.528	4.983.262	63.770	344.739	119	384.125	754.500	6.705	25.430	21.569									
Placements achetés à payer	2(a)	533.853	7.809.058	-	82.215	7.972.116	-	-	927.752	-	91.524	-									
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	-	1.426.767	487.587	53.387	3.023.282	-	659.955	-	-	-	82.226									
Moins-value non réalisée sur:																					
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	156.422	-	-	-	1.449.309	-	-	8.735	-	-	-									
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	5.559.082	3.994.958	165.645	31.678	754.500	4.029.704	74	224	-	-									
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	51.785	-	-	-									
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-									
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-									
Autres charges	4,5,6,7,8	32.159.487	1.154.213	386.595	3.194.143	25.096.450	47.011	1.877.441	15.069	20.464	35.598	18.925									
Total du passif		32.906.834	21.105.439	10.212.402	4.691.661	45.314.479	801.630	12.531.542	2.175.998	27.393	152.552	122.720									
Total de l'actif net		265.833.037	982.878.532	779.895.922	205.275.846	2.503.464.070	92.261.413	1.627.879.775	77.515.826	9.832.547	12.405.945	13.251.957									

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	ESG Global Conservative Income Fund		ESG Global Multi-Asset Income Fund		ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾		Euro Bond Fund		Euro Corporate Bond Fund		Euro Reserve Fund		Euro Short Duration Bond Fund		Euro-Markets Fund		European Equity Income Fund		European Focus Fund	
		EUR	USD	EUR	USD	EUR	USD	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Actif																					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		382.269.711	166.206.000	5.994.124.754	97.808.993	2.042.990.786	2.676.426.882	97.333.645	4.747.867.008	998.703.331	1.406.912.778	253.178.912									
Plus-values/(moins-values) non réalisées		(27.519.075)	(9.277.282)	(84.694.568)	(7.529.253)	(133.864.160)	(90.056.083)	(6.896)	(98.618.488)	256.685.249	143.702.317	70.948.227									
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	354.750.636	156.928.718	5.909.430.196	90.279.740	1.909.126.626	2.586.370.799	97.326.749	4.649.248.520	1.255.388.580	1.550.615.095	324.127.139									
Avoir en banque	2(a)	11.570.928	10.236.632	211.068.295	803.644	17.412.404	184.541.159	8.976.248	103.297.735	23.980.620	20.506.712	14.738.589									
Dus par le courtier	14	-	-	7.860.000	-	4.968.079	15.927.767	-	7.938.481	-	-	-									
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	3.406.236	1.362.206	18.107.293	1.249.586	16.241.650	33.040.704	152.023	31.076.265	143.304	1.361.600	206.758									
A recevoir sur placements vendus	2(a)	5.781	2.240	1.670	37.258	1.920.200	-	35.314.207	-	173.118	337.525	1.024.942									
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	166.320	374.333	2.194.015	-	12.274.980	1.550.346	1.515.706	35.751.170	371.112	711.073	18.062									
Plus-value non réalisée sur:																					
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	529.993	200.588	7.803.422	-	938.243	-	-	-	-	-	-									
Opérations de change à terme en cours	2(c)	520.510	-	-	-	465.043	-	-	-	-	3.163.261	55.217									
« Contrats for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-									
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-									
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	-	230.117	1.722.399	-	-	-	-	-									
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	136.103	60.663	9.240.467	-	-	-	-	-	-	-	-									
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	243.811	92.759	2.822.183	2.715	-	8.613	-	35.809	2.110.074	10.060.008	929.779									
Total des actifs		371.330.318	169.258.339	6.168.527.541	92.372.943	1.963.577.342	2.823.161.787	143.284.933	4.827.347.980	1.282.636.042	1.586.755.274	341.100.486									
Passif																					
Sommes dues à la banque	2(a)	-	-	25.918	-	1	-	-	10.414.095	5.192	1.351	-									
Dus au courtier	14	280.000	-	7.390.999	-	1.301.795	3.288.614	-	589.111	-	-	-									
Distribution de revenu payable	2(a)	39.144	8.888	8.616.679	-	927.851	59.307	-	523.404	428.930	15.473.814	-									
Placements achetés à payer	2(a)	1.843.530	1.695.173	22.933.485	46.127	8.887.625	8.967.420	5.986.533	15.697.452	-	74.319	51.734									
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	1.352.975	-	13.576.372	-	2.492.289	2.232.508	912.194	55.702.661	1.145.138	3.386.015	370.093									
Moins-value non réalisée sur:																					
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	14.214	-	1.017.588	-	1.054.033	-	-	-									
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	470.011	35.201.346	227.430	-	2.590.495	-	3.124	-	-	-									
« Contrats for difference »	2(c)	-	1.525	-	-	-	-	-	-	-	-	-									
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	11.068.564	-	-	-	-	436.332	-	-	-									
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	42.513	18.949	1.511.288	-	-	-	-	-	-	-	-									
Autres charges	4,5,6,7,8	553.300	26.230	8.898.497	38.001	1.900.655	1.558.171	82.524	3.362.158	1.816.774	2.338.404	597.647									
Total du passif		4.111.462	2.220.776	109.213.148	325.772	15.510.216	19.714.103	6.981.251	87.782.370	3.396.034	21.273.903	1.019.474									
Total de l'actif net		367.218.856	167.037.563	6.059.314.393	92.047.171	1.948.067.126	2.803.447.684	136.303.682	4.739.565.610	1.279.240.008	1.565.481.371	340.081.012									

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	European Fund		European High Yield Bond Fund		European Special Situations Fund		European Sustainable Equity Fund		European Value Fund		FinTech Fund		Fixed Income Global Opportunities Fund		Future Consumer Fund		Future Of Transport Fund		Global Allocation Fund		Global Corporate Bond Fund	
		EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Actif																							
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		1.022.018.699	330.070.714	947.740.381	5.020.236	602.176.671	327.395.319	7.165.826.553	13.863.317	1.737.191.722	13.458.543.875	887.303.980											
Plus-values/(moins-values) non réalisées		260.207.429	(18.526.634)	241.090.586	456.295	98.820.233	(80.589.957)	(487.788.565)	(1.125.534)	21.878.484	871.003.215	(34.414.776)											
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	1.282.226.128	311.544.080	1.188.830.967	5.476.531	700.996.904	246.805.362	6.678.037.988	12.742.783	1.759.070.206	14.329.547.090	852.889.204											
Avoir en banque	2(a)	46.858.440	1.865.243	49.927.054	90.849	21.113.831	4.867.558	478.171.155	201.333	69.842.577	158.627.288	14.284.502											
Dus par le courtier	14	-	884.000	-	-	-	-	174.775.919	-	-	17.414.768	4.226.498											
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	802.313	5.259.096	753.866	2.701	1.545.660	319.945	38.566.312	3.611	1.373.086	59.867.209	10.625.193											
A recevoir sur placements vendus	2(a)	3.891.074	93.764	3.650.646	-	-	3.381.094	1.651.189.149*	-	9.393.178	6.856.498	1.735.261											
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	1.960.353	2.853.965	894.672	19	221.944	1.223.565	2.059.465	109	883.282	12.046.295	1.451.372											
Plus-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	1.028.521	-	1.818.595	-	453.365	-	-	-	-	690.180	704.017											
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	164.457	-	-	261.087	611.534											
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-	-	-	-	711.632.994	-	-	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	53.698	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	-	-	-	-	-	-	25.726.022	-	-	59.165.050	73.470											
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	3.065.930	2.110	2.982.743	8.494	4.580.776	7.370	526.678	1.034	7.304	1.250.122	-											
Total des actifs		1.339.832.759	322.555.956	1.248.858.543	5.578.594	728.912.480	256.604.894	9.760.850.139	12.948.870	1.840.569.643	14.645.725.587	886.601.051											
Passif																							
Sommes dues à la banque	2(a)	59.409	17	9.919	-	10.809	-	-	-	27.989	6.812	-											
Dus au courtier	14	-	4.000	-	-	-	-	33.840.027	-	-	6.802.009	1.083.552											
Distribution de revenu payable	2(a)	16.824	977.599	3.089	-	224.211	11	3.240.674	-	13.906	28.764.337	947.220											
Placements achetés à payer	2(a)	214.155	25.967	195.688	-	-	152.413	2.351.901.253*	-	4.470.988	20.284.797	1.395.387											
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	672.208	193.740	7.990.802	1.453	3.199.683	194.260	2.766.254	697	1.371.224	17.773.502	582.901											
Moins-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	313.837	-	-	-	526.592	23.308.624	-	3.791.422	57.488.077	-											
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	13.163.598	-	-	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	-	-	-	67.771.680	-	-	1.122.104	2.505.240											
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	-	-	-	-	-	-	28.738.383	-	-	36.531.297	376.432											
Autres charges	4,5,6,7,8	1.440.675	308.330	1.685.010	3.616	901.621	418.522	11.684.733	6.942	2.773.415	21.675.756	903.459											
Total du passif		2.403.271	1.823.490	9.884.488	5.069	4.336.324	1.291.798	2.536.415.226	7.639	12.448.924	190.448.691	7.794.191											
Total de l'actif net		1.337.429.488	320.732.466	1.238.974.055	5.573.525	724.576.156	255.313.096	7.224.434.913	12.941.231	1.828.120.719	14.455.276.896	878.806.860											

* Comprend les « titres à déterminer » (To Be Announced Securities), pour plus d'informations voir le point 2 de l'Annexe aux états financiers.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Global Dynamic Equity Fund		Global Equity Income Fund		Global Government Bond Fund		Global High Yield Bond Fund		Global Inflation Linked Bond Fund		Global Long-Horizon Equity Fund		Global Multi-Asset Income Fund		Impact Bond Fund ⁽²⁾		India Fund		Japan Flexible Equity Fund		Japan Small & MidCap Opportunities Fund	
		USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	EUR	USD	USD	JPY	JPY				
Actif																							
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		341.371.566	820.543.458	1.058.230.841	1.749.342.936	290.743.696	1.230.592.650	4.899.247.758	76.421.278	415.466.992	29.634.896.554	18.184.722.145											
Plus-values/(moins-values) non réalisées		31.544.317	65.183.079	(76.792.220)	(144.327.265)	(21.548.038)	128.515.846	(217.118.060)	(2.575.388)	48.640.090	4.810.637.266	2.719.939.325											
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	372.915.883	885.726.537	981.438.621	1.605.015.671	269.195.658	1.359.108.496	4.682.129.698	73.845.890	464.107.082	34.445.533.820	20.904.661.470											
Avoir en banque	2(a)	35.189.052	37.064.939	27.417.913	32.260.536	895.035	23.338.816	186.956.197	2.016.175	12.470.277	382.571.172	499.916.955											
Dus par le courtier	14	-	-	5.176.871	4.550.000	407.388	-	641.821	182.736	-	-	-											
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	468.257	1.146.095	8.099.307	27.788.083	698.856	988.247	40.799.757	680.937	444.228	34.510.528	31.131.577											
A recevoir sur placements vendus	2(a)	92.729	-	236.759*	954.589	2.798.757*	-	6.466.724	-	4.110.362	139.107.994	206.898.431											
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	1.507.316	157.280	476.462	1.808.816	63.758	4.689.735	4.139.236	-	999.142	36.001.424	68.626.241											
Plus-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	651.223	-	1.261.376	1.023	-	-	6.189.033	-	-	-	-											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	-	3.474.916	4.401.287	823.686	-	604.714	-	-	155.458.785	38.482.236											
« Contracts for difference »	2(c)	130.550	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	54.673.749	-	21.140.054	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	1.988.734	-	1.215.970	1.575.731	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	42.034	-	377.660	7.130	1.333.214	-	1.784.926	-	-	-	-											
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	412.985.778	924.636.178	1.083.935.828	1.678.365.728	297.356.717	1.388.125.294	4.931.379.749	76.850.444	482.265.309	35.193.183.653	21.749.724.246											
Passif																							
Sommes dues à la banque	2(a)	-	1.291.512	-	-	24.011	-	503	-	-	-	-											
Dus au courtier	14	-	-	1.841.383	1.776.752	-	-	1.810.000	9.156	-	-	-											
Distribution de revenu payable	2(a)	70.459	869.293	471.406	4.103.354	31	-	20.846.871	-	-	1.538.341	244.649											
Placements achetés à payer	2(a)	171.987	-	56.367.251*	1.940.861	23.915.491*	-	43.238.645	-	4.215.124	43.957.404	123.253.669											
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	414.538	577.357	4.362.023	2.075.444	517.115	574.654	4.975.810	-	387.313	68.777.343	132.728.980											
Moins-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	-	133.005	-	-	35.191	-	-	-											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	2.058.793	1.174.681	-	-	-	175	9.352.217	438.683	-	-	-											
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	606.656	-	546.895	-	215.478	-	330.556	55.733	-	-	-											
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	732.756	1.547.960	912.451	4.558.731	1.292.428	-	557.539	-	-	-	-											
Autres charges	4,5,6,7,8	4.055.189	5.460.803	64.491.409	14.455.142	27.070.303	3.057.442	90.503.372	551.140	7.909.279	163.041.488	294.636.108											
Total du passif		408.930.589	919.175.375	1.019.444.419	1.663.910.586	270.286.414	1.385.067.852	4.840.876.377	76.299.304	469.753.593	35.030.142.165	21.455.088.138											
Total de l'actif net																							

* Comprend les « titres à déterminer » (To Be Announced Securities), pour plus d'informations voir le point 2 de l'Annexe aux états financiers.

② Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Latin American Fund		Multi-Theme Equity Fund		Natural Resources Fund ⁽⁷⁾		Next Generation Health Care Fund		Next Generation Technology Fund		Nutrition Fund		Sustainable Asian Bond Fund		Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund		Sustainable Emerging Markets Bond Fund		Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund		Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	
		USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Actif																							
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		851.366.525	165.823.145	372.925.020	17.137.680	2.133.865.951	285.288.072	111.999.659	45.885.728	225.214.160	55.779.386	507.601.867											
Plus-values/(moins-values) non réalisées		71.471.865	(1.937.136)	821.264	411.085	422.572.056	(24.903.098)	(4.328.984)	(4.481.135)	(28.659.232)	(3.645.532)	(20.700.495)											
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	922.838.190	163.886.009	373.746.284	17.548.765	2.556.438.007	260.384.974	107.670.675	41.404.593	196.554.928	52.133.854	486.901.372											
Avoir en banque	2(a)	7.126.389	420.166	4.365.709	1.036.543	18.243.923	10.483.630	2.173.927	270.795	20.317.555	604.054	11.664.384											
Dus par le courtier	14	-	-	-	-	-	-	1.600.869	267.601	12.002	-	1.516.283											
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	10.544.452	955	2.865.330	9.148	1.653.254	235.781	1.123.664	642.318	2.690.621	736.116	7.354.980											
A recevoir sur placements vendus	2(a)	-	-	695.334	-	687.016	-	6.130	450.275	-	-	-											
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	1.243.696	341.452	173.019	2.522	1.043.892	128.330	-	3.115	99.439	35.892	9.611											
Plus-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	-	-	-	77.497	24.884	35.381	19.969	81.001											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	80.901	-	-	-	-	202.905	-	-	-	-											
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	346.949	38.748	950.141											
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	-	-	-	-	-	-	26.028	28.584	-	-	595.066											
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	-	42.100	529.937	926	60.130	309.095	-	12.371	1.068	1.110	592.559											
Total des actifs		941.752.727	164.771.583	382.375.613	18.597.904	2.578.126.222	271.541.810	112.881.695	43.104.536	220.057.943	53.589.743	509.665.397											
Passif																							
Sommes dues à la banque	2(a)	-	-	-	171.021	-	-	-	8.087	43	-	-											
Dus au courtier	14	-	-	-	-	-	-	69	62.882	590.014	130.000	1.516.650											
Distribution de revenu payable	2(a)	205.553	-	3.331.288	-	47	5.068	51	-	52	-	-											
Placements achetés à payer	2(a)	1.466.811	304.014	-	-	-	-	561.151	-	-	-	-											
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	1.510.907	61.417	261.068	32.287	3.640.088	649.480	-	219	160.256	-	29.478											
Moins-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	151.090	-	346.775	10.325	5.107.620	148.071	-	145.652	3.072.533	272.962	906.777											
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	-	-	-	13.531	8.485	-	-	-											
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	-	-	-	-	-	-	4.100	-	-	-	-											
Autres charges	4,5,6,7,8	1.794.041	160.033	1.765.424	13.142	3.862.047	422.688	71.247	81.901	175.887	39.768	327.495											
Total du passif		5.128.402	525.464	5.704.545	226.775	12.609.802	1.225.307	650.149	307.226	3.998.785	442.730	2.780.400											
Total de l'actif net		936.624.325	164.246.119	376.671.068	18.371.129	2.565.516.420	270.316.503	112.231.546	42.797.310	216.059.158	53.127.013	506.884.997											

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Sustainable Energy Fund		Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund		Sustainable Global Allocation Fund ⁽²⁾		Sustainable Global Income Bond Fund ⁽⁴⁾		Sustainable Global Infrastructure Fund		Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾		Swiss Small & MidCap Opportunities Fund ⁽⁵⁾		Systematic China Environmental Tech Fund ⁽²⁾		Systematic Global Equity High Income Fund		Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund ⁽²⁾	
		USD	EUR	USD	EUR	USD	USD	USD	USD	USD	CHF	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	
Actif																					
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		6.450.184.238	464.784.307	77.064.519		108.627.525	11.957.745	972.405.138	474.019.991	588.362.870	16.447.131	4.649.015.058	19.850.467								
Plus-values/(moins-values) non réalisées		417.292.499	(28.934.678)	7.433.824		(5.113.794)	(1.004.211)	(73.881.234)	127.301.816	(54.012.106)	(570.712)	93.924.427	808.132								
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	6.867.476.737	435.849.629	84.498.343		103.513.731	10.953.534	898.523.904	601.321.807	534.350.764	15.876.419	4.742.939.485	20.658.599								
Avoir en banque	2(a)	90.995.802	67.290.859	11.902.259		7.386.583	650.122	15.138.593	601.698	15.392.695	226.404	351.653.461	1.968.027								
Dus par le courtier	14	-	10.666.228	99.510		501.299	-	11.750.175	-	-	-	-	-								
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	4.147.980	2.468.960	147.485		1.154.037	35.609	7.348.806	6.552	22.963	5.509	12.529.169	23.637								
A recevoir sur placements vendus	2(a)	54.703.414	108.054.243*	-		118.906*	-	9.814.600*	-	-	-	75.248.781	228.502								
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	7.082.312	313	-		47.297	856	280.349	-	77.800	-	78.528.499	207.963								
Plus-value non réalisée sur:																					
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-		-	-	-	-	180.575	2.515	4.187.131	54.304								
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	-	-		-	-	6.555.123	-	-	-	-	1.057								
« Contrats for difference »	2(c)	-	12.613	-		-	-	-	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	49.280.807	5.391.795		10.603.407	-	88.728.846	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	34.637		-	-	-	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	-	1.787.969	272.174		6.083	-	742.349	-	-	-	-	-								
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	3.567.998	41.017	20.120		1.975	8.329	101.983	41.417	-	2.100	5.604.228	23.252								
Total des actifs		7.027.974.243	675.452.638	102.366.323		123.333.318	11.648.450	1.038.984.728	601.971.474	550.024.797	16.112.947	5.270.690.754	23.165.341								
Passif																					
Sommes dues à la banque	2(a)	-	-	-		-	-	6.606	-	-	-	2.292	-								
Dus au courtier	14	-	1.862.904	-		19.688	-	951.696	-	-	-	-	-								
Distribution de revenu payable	2(a)	1.300.920	523.289	40		173.561	-	821.566	-	-	-	70.822.594	25.405								
Placements achetés à payer	2(a)	62.849.423	153.659.537*	5.458.082*		11.304.018*	-	93.395.692*	268.930	-	-	146.507.048	1.008.872								
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	10.400.092	17.029	357.443		253	-	7.788.959	242.965	1.167.100	-	3.367.188	-								
Moins-value non réalisée sur:																					
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	785.111	3.630		191.172	-	124.807	-	-	-	-	-								
Opérations de change à terme en cours	2(c)	2.305.698	4.400.020	499.048		126.647	-	-	-	85.533	54	10.763.436	-								
« Contrats for difference »	2(c)	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	4.097.597	-		61.716	-	7.533.582	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	-	2.582.351	97.264		15.417	-	2.272.590	-	-	-	23.415.247	118.887								
Autres charges	4,5,6,7,8	11.260.200	750.945	29.623		74.933	6.002	763.113	716.317	648.409	9.645	7.103.022	17.749								
Total du passif		88.116.333	168.678.783	6.445.130		11.967.405	6.002	113.658.611	1.228.212	1.901.045	9.699	261.980.827	1.170.913								
Total de l'actif net		6.939.857.910	506.773.855	95.921.193		111.365.913	11.642.448	925.326.117	600.743.262	548.123.752	16.103.248	5.008.709.927	21.994.428								

* Comprend les « titres à déterminer » (To Be Announced Securities), pour plus d'informations voir le point 2 de l'Annexe aux états financiers.

(2) Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(4) Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(5) Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Systematic Sustainable Global SmallCap Fund(s) ⁽⁴⁾		United Kingdom Fund		US Basic Value Fund		US Dollar Bond Fund		US Dollar High Yield Bond Fund		US Dollar Reserve Fund		US Dollar Short Duration Bond Fund		US Flexible Equity Fund		US Government Mortgage Impact Fund		US Growth Fund		US Mid-Cap Value Fund	
		USD	GBP	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Actif																							
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		244.004.070	192.828.584	849.412.510	578.509.319	1.946.510.061	338.968.388	1.652.940.266	1.556.017.666	104.140.453	279.864.162	232.492.974											
Plus-values/(moins-values) non réalisées		3.652.690	18.761.213	(816.801)	(46.299.828)	(131.425.519)	(15.289)	(59.646.219)	299.629.194	(17.419.002)	111.190.427	(70.132)											
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	247.656.760	211.589.797	848.595.709	532.209.491	1.815.084.542	338.953.099	1.593.294.047	1.855.646.860	86.721.451	391.054.589	232.422.842											
Avoir en banque	2(a)	5.308.121	1.071.880	41.444.763	28.430.009	44.940.180	190.395.040	21.009.575	27.789.697	481.319	202.133	11.070.315											
Dus par le courtier	14	-	-	-	582.609	1.677.000	-	2.090.000	-	-	-	-											
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	254.531	1.355.088	1.754.181	3.908.351	30.926.301	1.382.772	12.677.291	1.487.472	311.416	112.581	391.471											
A recevoir sur placements vendus	2(a)	684	-	956.609	62.538.204*	153.065	-	15.707.399*	-	13.096.105*	1.037.182	137.166											
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	2.968.378	66.981	518.839	322.677	21.380.540	1.860.145	510.190	1.688.894	31.294	1.653.526	221.162											
Plus-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	23.455	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	48.106	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-	67.776.286	-	-	48.695.934	-	5.466.061	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	2.778.654	8.159	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	-	-	-	2.666	4.294	-	-	-	-	-	-											
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	120.101	81.050	153.841	2.666	4.294	-	-	185.182	-	-	49.034											
Total des actifs		256.332.030	214.212.902	893.423.942	698.548.947	1.915.417.559	532.591.056	1.693.984.436	1.886.798.105	106.127.646	394.060.011	244.291.990											
Passif																							
Sommes dues à la banque	2(a)	-	1.796	-	-	-	-	152.782	-	-	-	335											
Dus au courtier	14	-	-	-	327.548	1.322.390	-	-	-	-	-	-											
Distribution de revenu payable	2(a)	-	434.832	109.904	222.985	5.835.800	-	486.853	-	21.778	-	-											
Placements achetés à payer	2(a)	56.172	486.161	970.316	127.827.753*	18.812.078	-	64.506.827*	-	18.661.899*	941.396	290.866											
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées																							
Moins-value non réalisée sur:																							
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	137.079	880	-	1.537.331	-	-	-	-											
Opérations de change à terme en cours	2(c)	47.947	-	272.052	358.704	48.624	71.158	1.574.441	1.655.263	62	222.473	6.305											
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-											
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	473.729	-	-	790.803	-	-	-	-											
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	-	-	-	2.320.819	-	-	-	-	-	-	-											
Autres charges	4,5,6,7,8	874.993	350.993	1.192.788	894.562	2.105.114	286.256	1.316.114	2.164.528	201.959	604.374	431.607											
Total du passif		1.047.266	1.411.196	3.654.019	144.882.212	29.529.815	18.010.880	75.861.858	5.050.354	18.951.964	1.996.301	901.839											
Total de l'actif net		255.284.764	212.801.706	889.769.923	553.666.735	1.885.887.744	514.580.176	1.618.122.578	1.881.747.751	87.175.682	392.063.710	243.390.151											

* Comprend les « titres à déterminer » (To Be Announced Securities), pour plus d'informations voir le point 2 de l'Annexe aux états financiers.

(4) Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Bilan

au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	US Sustainable Equity Fund		World Energy Fund		World Financials Fund		World Gold Fund		World Healthscience Fund		World Mining Fund		World Real Estate Securities Fund		World Technology Fund	
		USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Actif																	
Portefeuille de titres au coût d'acquisition		4.699.915	2.431.965.322	1.573.699.978	4.030.628.674	11.374.721.512	4.281.902.678	207.551.234	6.447.775.699								
Plus-values/ (moins-values) non réalisées		69.554	529.898.378	119.774.668	(101.671.127)	2.234.583.466	892.387.156	(11.997.133)	3.343.450.581								
Portefeuille de titres à la valeur de marché	2(a)	4.769.469	2.961.863.700	1.693.474.646	3.928.957.547	13.609.304.978	5.174.289.834	195.554.101	9.791.226.280								
Avoir en banque	2(a)	50.777	29.607.062	96.711.945	51.695.556	43.404.272	200.972.455	2.428.550	17.234.838								
Dus par le courtier	14	-	-	-	-	4.750.000	-	40.000	-								
Intérêts et dividendes à recevoir	2(a)	5.977	12.657.679	8.970.666	10.760.765	12.105.660	30.026.905	291.795	3.574.021								
A recevoir sur placements vendus	2(a)	-	1.524.348	-	2.284.246	-	30.251.076	3.408	1.899.101								
A recevoir au titre des actions du Compartiment souscrites	2(a)	-	4.076.651	4.024.531	5.965.446	10.674.138	2.784.862	125.435	13.029.298								
Plus-value non réalisée sur:																	
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	172.265								
Valeur de marché des contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des options/swaptions achetées	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
Autres éléments de l'actif	2(a,c)	748	209.990	1.549.993	9.051	2.825.963	21.302	19.038	20.759								
Total des actifs		4.826.971	3.009.939.430	1.804.731.781	3.999.672.611	13.683.065.011	5.438.346.434	198.634.592	9.826.984.297								
Passif																	
Sommes dues à la banque	2(a)	-	3.421	25.987	-	-	26.538	-	-								
Dus au courtier	14	-	-	-	-	-	-	-	-								
Distribution de revenu payable	2(a)	-	2.312.585	204.623	42.975	129.945	3.699.884	17.840	160.722								
Placements achetés à payer	2(a)	-	-	715.445	3.401.068	-	5.165.638	-	-								
A payer au titre des actions du Compartiment rachetées	2(a)	-	6.998.272	4.709.472	4.613.537	17.591.306	7.724.464	60.695	10.069.933								
Moins-value non réalisée sur:																	
Contrats à terme ouverts négociés en bourse	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
Opérations de change à terme en cours	2(c)	-	2.087.343	223.388	3.409.996	32.510.692	2.481.801	333.996	3.100.908								
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des swaps	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
Valeur de marché des options/swaptions vendues	2(c)	-	-	-	-	-	-	-	-								
Autres charges	4,5,6,7,8	9.618	8.453.738	7.243.331	6.948.325	21.027.494	9.566.513	328.293	14.864.082								
Total du passif		9.618	19.855.359	13.122.246	18.415.901	71.259.437	28.664.838	740.824	28.195.645								
Total de l'actif net		4.817.353	2.990.084.071	1.791.609.535	3.981.256.710	13.611.805.574	5.409.681.596	197.893.768	9.798.788.652								

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Asia Pacific Equity Income Fund⁽¹⁾				
Total de l'actif net	USD	74.973.053^o	116.844.096	173.509.204
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR	EUR	7,76 ^o	7,80	10,13
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	USD	11,81 ^o	11,77	14,87
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD	SGD	10,52 ^o	10,59	13,46
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	11,19 ^o	11,33	14,53
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	ZAR	83,54 ^o	84,27	106,79
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	CNH	96,21 ^o	98,19	125,30
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	12,21 ^o	12,20	15,49
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	91,39 ^o	91,86	117,38
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	17,77 ^o	17,43	21,45
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	22,92 ^o	18,24	18,90
Action de Catégorie C de distribution (Q) (G)	USD	10,04 ^o	10,07	12,88
Action de Catégorie C de distribution (Q) (G) couverte en SGD	SGD	8,95 ^o	9,07	11,67
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	16,77 ^o	13,30	14,11
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G)	USD	12,89 ^o	12,81	16,06
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) couverte en SGD	SGD	11,51 ^o	11,51	14,52
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	19,42 ^o	18,99	23,19
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	7,13 ^o	7,31	9,49
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	17,14 ^o	16,48	20,38
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	12,30 ^o	12,00	14,63
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	14,62 ^o	14,22	17,19
Asian Dragon Fund				
Total de l'actif net	USD	783.596.715	865.199.577	1.176.221.240
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	41,96	36,33	38,89
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	43,95	43,92	55,82
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	13,52	13,96	18,00
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	11,87	12,48	16,18
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,14	12,62	16,44
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	120,54	118,58	150,02
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	13,09	13,36	17,09
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	31,72	32,10	41,32
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	42,34	36,65	39,24
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	49,39	48,99	61,81
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	AUD	20,70	21,21	27,14
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	12,60	13,15	16,91
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,90	13,31	17,21
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	39,51	39,68	50,70
Action de distribution (A) de Catégorie I	USD	12,23	12,30	15,63
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	12,22	10,58	11,33
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	13,38	13,24	16,66
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	AUD	10,15	10,38	13,25
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	40,15	34,76	37,27
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	55,98	54,97	68,66

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP.

Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

^o Le total de l'actif net et la valeur liquidative par catégorie d'actions ont été communiqués pour la date de valorisation finale du 2 mars 2023.

⁽¹⁾ Compartiment dissous au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Asian Growth Leaders Fund				
Total de l'actif net	USD	590.489.089	838.847.579	1.435.246.176
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	12,12	12,56	17,33
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	10,84	11,44	15,86
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,14	11,63	16,21
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	13,08	13,41	18,35
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	18,59	16,08	18,41
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	8,75	8,80	11,98
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	11,51	12,06	16,60
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,84	12,27	16,97
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	9,55	9,72	13,20
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	19,84	17,03	19,37
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	22,39	22,60	30,89
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,02	7,81	8,98
Action de distribution (Q) de Catégorie I	USD	12,88	13,01	17,63
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	14,40	14,32	19,27
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	11,07	11,02	14,85
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,78	10,24	14,06
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,88	10,22	14,12
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en GBP	GBP	10,40	10,58	14,43
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en SGD	SGD	10,68	10,85	14,71
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	22,53	22,23	29,69
Asian High Yield Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	1.514.907.587	2.117.939.025	1.758.081.147
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (Q) de Catégorie A	USD	5,75	6,54	–
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	4,95	5,76	9,78
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	EUR	4,94	5,73	9,74
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en GBP	GBP	5,02	5,77	9,77
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	HKD	50,11	58,21	98,49
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en SGD	SGD	5,56	6,48	10,94
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	CNH	49,26	59,22	100,09
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	4,62	5,33	8,97
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	7,47	7,81	11,89
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	6,62	7,10	10,94
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,46	6,97	10,82
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	6,70	7,09	10,88
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	68,37	72,45	110,97
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	7,47	7,95	12,15
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	4,87	5,74	9,51
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	5,56	6,42	–
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	USD	4,90	5,62	9,38
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	7,67	7,98	12,11
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	6,09	6,54	10,11
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	6,51	6,86	–
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	4,34	5,10	8,47
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	8,93	9,39	14,38
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,27	6,81	10,64
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	USD	5,03	5,76	9,65
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	6,18	6,43	9,73
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	5,94	6,37	9,83
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	7,97	8,24	12,42

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Asian Multi-Asset Income Fund				
Total de l'actif net	USD	69.591.926	73.282.472	90.901.838
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	7,54	8,17	10,61
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	AUD	9,77	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	CAD	9,77	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	CNH	97,52	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	9,77	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	9,78	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	7,15	7,85	10,25
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en JPY	JPY	974	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	7,05	7,77	10,13
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	12,10	12,16	15,01
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	12,98	12,93	15,81
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	13,73	13,59	16,50
Asian Sustainable Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	8.395.240	4.576.810	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	8,96	9,08	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,07	7,86	–
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	9,92	10,09	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,11	7,86	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,19	7,88	–
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	9,06	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Asian Tiger Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	2.794.010.377	3.526.988.067	5.509.491.295
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	9,52	10,00	12,88
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	9,52	10,01	12,89
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	AUD	7,77	8,33	10,81
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	EUR	6,32	6,85	8,97
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en HKD	HKD	8,04	8,56	11,09
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	NZD	8,35	8,84	11,40
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en SGD	SGD	7,27	7,75	10,01
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	7,69	8,22	10,90
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	CAD	7,45	7,95	10,50
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	67,17	74,09	98,14
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	8,14	8,65	11,43
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	ZAR	73,46	78,77	103,66
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	7,97	8,48	11,18
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	CNH	98,50	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	6,28	6,89	9,24
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	4,84	5,22	6,93
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	58,52	63,01	83,57
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	6,39	6,89	9,11
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	36,64	36,96	46,23
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,44	8,78	11,17
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	77,11	78,77	99,10
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	11,62	11,89	14,90
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	9,65	10,14	13,06
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	27,29	27,87	35,31
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	6,94	7,40	9,63
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	9,53	10,02	12,90
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en HKD	HKD	8,05	8,57	11,10
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en SGD	SGD	7,15	7,62	9,84
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	USD	8,49	8,99	11,78
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	12,42	12,47	15,52
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,00	10,34	13,09
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	11,43	11,63	14,50
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	32,99	33,44	42,05
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,68	9,07	11,60
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	6,94	7,41	9,63
Action de Catégorie I de distribution (M)	USD	8,26	8,68	11,18
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	6,41	6,93	9,07
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	11,06	11,09	13,78
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,93	9,23	11,65
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SGD	SGD	8,99	9,13	11,37
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	8,49	8,89	11,23
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	7,15	7,62	9,92
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,33	6,64	7,20
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,08	6,98	7,31
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	7,68	7,94	10,03
Action de Catégorie X de distribution (M)	USD	7,95	8,34	10,72
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	9,64	9,61	11,89
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,73	8,97	11,28

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Brown To Green Materials Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	USD	20.423.202	–	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	10,14	–	–
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	10,82	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,15	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,81	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,17	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,18	–	–
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,16	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
China Bond Fund				
Total de l'actif net	CNH	26.253.457.860	38.725.399.779	60.649.931.844
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (M) de Catégorie A	CNH	63,52	66,63	74,00
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	HKD	99,74	–	–
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	USD	9,99	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	CNH	86,27	91,84	103,74
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	AUD	7,89	8,34	9,69
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	7,38	7,87	9,24
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	78,88	83,14	96,68
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	8,06	8,48	9,81
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	USD	8,18	8,51	9,85
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CAD	CAD	7,94	8,31	9,62
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	7,84	8,25	9,57
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en NZD	NZD	7,98	8,34	9,62
Action de capitalisation de Catégorie A	CNH	99,03	99,95	107,01
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	JPY	877	911	1.007
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	9,94	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	9,92	9,79	10,73
Action de capitalisation de Catégorie AI	CNH	79,01	79,79	85,42
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,53	9,64	10,70
Action de capitalisation de Catégorie C	CNH	85,56	87,41	94,79
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,29	8,58	9,80
Action de distribution (M) de Catégorie D	CNH	63,80	66,92	74,33
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	CNH	83,50	88,65	99,46
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	8,27	8,66	9,96
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	USD	8,11	8,42	9,72
Action de capitalisation de Catégorie D	CNH	100,16	100,73	107,47
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	9,95	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	9,29	9,36	10,36
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	9,81	9,65	10,54
Action de distribution (Q) de Catégorie E	CNH	71,59	75,02	83,41
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	8,08	8,49	9,79
Action de Catégorie E de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	EUR	8,29	8,69	9,85
Action de capitalisation de Catégorie E	CNH	121,01	122,72	132,09
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,63	9,80	10,94
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,29	8,58	9,80
Action de Catégorie I de distribution (M)	CNH	61,62	64,64	71,80
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	8,18	8,58	9,91
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	CNH	87,03	92,25	103,71
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	8,30	8,68	9,96
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	USD	8,59	8,89	10,24
Action de capitalisation de Catégorie I	CNH	126,37	126,88	135,17
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	9,33	9,39	10,38
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	9,87	9,69	10,56
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,94	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en USD	USD	9,97	–	–
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,45	8,74	9,99
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	CNH	56,53	7,41	7,41
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	CNH	87,42	11,54	–
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	8,43	8,95	–
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	HKD	86,16	90,15	–
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	SGD	8,68	9,06	–
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	8,76	9,06	–
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	CNH	95,61	12,00	11,51
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	9,08	9,14	10,11
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	9,47	9,30	10,14
Action de Catégorie X de distribution (M)	CNH	62,93	65,95	–
Action de capitalisation de Catégorie X	CNH	79,96	80,03	84,91
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD	USD	10,22	9,99	10,85

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
China Flexible Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	21.870.838	22.576.970	31.646.134
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	6,93	7,91	12,07
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	5,86	6,96	10,91
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,54	7,76	12,16
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	7,24	8,19	12,41
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,70	7,90	12,28
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	5,43	6,49	10,22
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	7,94	9,10	13,96
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	5,70	6,80	10,71
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	7,37	8,32	12,56
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,76	7,95	12,32
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	7,69	8,62	12,92
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	7,35	8,30	12,54
China Fund				
Total de l'actif net	USD	1.020.332.702	1.153.645.347	1.615.607.258
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	12,02	14,34	21,90
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	10,58	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	15,08	17,56	26,44
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	11,38	13,84	21,13
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	98,59	120,21	178,61
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,46	13,92	21,54
Action de Catégorie A de capitalisation en HKD	HKD	15,46	18,02	26,92
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	12,79	15,29	23,19
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,80	8,27	12,79
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	12,44	14,67	22,36
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	12,23	14,60	22,23
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	16,74	19,35	28,91
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,44	15,00	23,03
Action de Catégorie D de capitalisation en HKD	HKD	130,86	151,47	224,49
Action de Catégorie D de capitalisation en SGD	SGD	13,89	16,47	24,80
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,01	10,66	16,16
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,65	13,01	20,22
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	17,31	19,96	29,74
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,03	8,46	12,95
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	17,18	19,66	29,08
China Impact Fund				
Total de l'actif net	USD	25.802.680	30.463.840	18.565.831
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	8,90	11,35	14,76
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,15	9,47	12,62
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,15	11,58	14,96
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,33	9,62	12,73
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,04	9,37	12,55
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,24	11,66	15,03
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,39	9,68	12,77
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	9,51	11,92	15,24
China Innovation Fund				
Total de l'actif net	USD	20.782.256	20.651.662	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,91	10,18	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	95,30	101,64	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,01	8,79	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	CNH	96,33	101,89	–
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	10,22	10,56	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,04	8,80	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,13	8,81	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
China Multi-Asset Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	USD	19.507.301	-	-
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	9,68	-	-
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	CNH	96,26	-	-
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	HKD	96,73	-	-
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,73	-	-
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,74	-	-
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	9,75	-	-
China Onshore Bond Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	CNH	760.119.352	-	-
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	HKD	100,59	-	-
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	USD	10,09	-	-
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	CNH	97,61	-	-
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	CNH	100,86	-	-
Action de capitalisation de Catégorie E	CNH	73,96	-	-
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,11	-	-
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,17	-	-
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	CNH	101,52	-	-
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	CNH	102,02	-	-
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	10,42	-	-
Action de Catégorie ZI de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	USD	10,04	-	-
Action de capitalisation de Catégorie ZI	CNH	102,17	-	-
Circular Economy Fund				
Total de l'actif net	USD	1.663.241.692	1.796.330.423	2.309.316.574
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,30	6,47	7,61
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	9,96	-	-
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	AUD	9,86	-	-
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	CNH	97,95	-	-
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	HKD	99,07	-	-
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	12,36	11,19	15,62
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	8,77	8,15	11,61
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	CAD	8,98	8,22	11,61
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	91,16	85,07	117,44
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,58	8,05	11,57
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	8,83	8,18	11,61
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	90,23	82,64	116,16
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	NZD	8,90	8,20	11,62
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	11,11	10,23	14,43
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	13,34	12,08	16,86
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	10,80	-	-
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	12,75	11,45	15,86
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	11,51	10,57	14,89
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	12,12	11,02	15,47
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	12,74	9,92	11,62
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	12,89	11,55	15,95
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	1.245	1.181	1.653
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,20	7,17	8,39
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,35	7,23	8,42
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	8,74	8,12	11,56
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	13,24	11,78	16,16
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	12,92	11,56	15,96

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Climate Action Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	4.565.916	4.083.788	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	8,31	8,01	–
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	9,38	9,05	–
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	10,12	9,91	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	8,42	8,05	–
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	9,32	9,02	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	8,46	8,07	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	8,56	8,11	–
Climate Action Multi-Asset Fund				
Total de l'actif net	EUR	45.540.524	47.930.052	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	USD	8,70	9,45	–
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	8,82	9,47	–
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	8,83	9,48	–
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	8,65	9,39	–
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	8,92	9,52	–
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	8,75	9,44	–
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	8,96	9,53	–
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	9,05	9,58	–
Continental European Flexible Fund				
Total de l'actif net	EUR	5.321.200.206	5.070.548.567	8.815.637.037
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	EUR	38,94	32,83	43,94
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	38,66	28,10	37,43
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	37,93	31,53	41,80
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	39,92	33,59	44,94
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	22,71	18,53	24,24
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	39,92	28,94	38,56
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	16,19	13,62	18,23
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	32,09	27,34	37,05
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	39,76	28,87	38,28
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	39,04	32,44	42,80
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	67,67	55,32	72,02
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	44,59	37,23	49,45
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	64,15	51,96	67,46
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	44,58	32,09	42,42
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	41,50	34,17	44,96
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	36,48	30,84	41,49
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	26,74	19,42	25,76
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	23,55	19,25	25,07
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	30,83	25,68	34,02
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	23,49	18,98	24,58
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	30,83	22,13	29,19
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,32	7,65	–
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,50	7,63	10,12
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	11,11	9,08	11,83
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,67	7,67	10,13
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	11,28	9,13	11,84
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	39,99	29,03	38,55
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	50,29	41,57	54,67

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Developed Markets Sustainable Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	17.304.463	10.787.561	5.466.824
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,41	8,66	10,86
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,60	8,75	10,89
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,60	7,54	7,90
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	10,14	9,38	11,83
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,66	8,78	10,89
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,65	7,56	7,90
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,79	7,62	7,91
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	10,43	–	–
Dynamic High Income Fund				
Total de l'actif net	USD	2.831.754.359	3.119.186.697	3.578.551.682
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	7,19	7,47	9,55
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	73,63	78,17	99,53
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	EUR	8,06	8,29	10,59
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	7,56	7,80	9,93
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	7,54	7,78	9,86
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	CAD	7,34	7,66	9,77
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	6,53	6,98	9,04
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	6,86	7,23	9,26
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	72,70	76,05	96,93
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	7,16	7,51	9,57
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	11,05	10,58	12,58
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,44	9,45	11,47
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	10,51	10,21	12,21
Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	7,51	7,95	10,21
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,78	9,68	11,75
Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,10	8,40	10,59
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	USD	7,89	8,07	10,14
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	11,53	10,96	12,93
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,82	9,77	11,77
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,17	9,99	12,03
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	6,86	7,30	9,42
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	13,33	12,84	15,33
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,37	9,32	11,37
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	USD	8,15	8,32	10,44
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	11,76	11,15	13,13
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	USD	10,10	8,54	9,36
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,29	10,08	12,12
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	12,16	11,45	13,37
Emerging Europe Fund⁽³⁾				
Total de l'actif net	EUR	265.833.037	161.213.607	758.920.271
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	EUR	47,26	28,66	119,50
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	47,41	28,75	102,84
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	53,19	32,26	134,49
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	5,45	3,26	12,97
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	39,69	24,07	100,98
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	47,46	28,78	102,56
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	60,42	36,64	152,19
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	48,42	28,97	115,38
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	47,38	28,73	120,09
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	5,18	3,14	13,02
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	47,83	28,92	102,37
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	6,64	4,00	16,53

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Emerging Markets Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	982.878.532	912.526.191	1.564.148.104
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	10,91	10,57	14,06
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	7,78	7,55	9,97
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	8,03	7,79	10,30
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	6,21	6,19	8,38
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	6,90	6,86	9,29
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	ZAR	69,55	69,54	93,97
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	CNH	76,48	78,24	105,78
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	6,52	6,45	8,68
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	CAD	6,78	6,77	9,17
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	6,40	6,46	8,76
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	47,57	47,70	64,63
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	17,22	15,99	20,37
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,96	13,42	17,46
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	10,28	9,73	12,49
Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	7,23	7,26	9,80
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,46	8,14	10,59
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	7,78	7,55	9,97
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	13,59	12,78	16,49
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	8,05	7,81	10,32
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	18,95	17,50	22,16
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	14,88	14,23	18,40
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	18,96	15,08	16,08
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	6,76	6,78	9,15
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	15,70	14,66	18,77
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,94	8,64	11,30
Action de distribution (A) de Catégorie I	USD	7,86	7,62	10,13
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	7,33	7,36	10,01
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	7,62	7,51	10,09
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	6,95	6,97	9,41
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	17,19	15,84	20,03
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,15	9,69	12,51
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	8,42	8,12	10,45
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,20	8,63	10,99
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en CHF	CHF	7,48	7,59	10,22
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	6,69	6,72	9,07
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	21,30	19,51	24,51
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	17,11	16,23	20,81

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Emerging Markets Corporate Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	779.895.922	808.537.589	1.148.076.472
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	12,40	12,10	14,38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,41	10,46	12,66
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,63	11,34	13,48
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,45	8,73	10,77
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	13,44	13,02	15,36
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,44	9,42	11,32
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	7,66	8,02	10,00
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	15,70	15,40	18,38
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,84	9,94	12,09
Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	EUR	7,49	7,86	9,85
Action de Catégorie I de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	–	8,73	10,77
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	7,81	8,18	10,20
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	13,63	13,18	15,52
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	CHF	10,24	10,34	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,64	11,59	13,90
Action de Catégorie SR de distribution (M)	USD	9,90	–	–
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	7,96	8,23	10,16
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,03	7,53	7,47
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	8,59	8,56	10,26
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	14,75	14,16	16,56
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY	JPY	919	932	1.103
Emerging Markets Equity Income Fund				
Total de l'actif net	USD	205.275.846	314.381.909	507.438.453
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	USD	10,96*	10,30	14,47
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	10,78*	10,35	14,78
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	112,05*	110,01	155,92
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	10,99*	10,51	14,94
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	11,69*	11,08	15,62
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	CAD	10,74*	10,32	14,70
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	9,36*	9,22	13,39
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	10,21*	9,89	14,15
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	86,51*	83,05	117,94
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	10,67*	10,31	14,68
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	16,25*	14,75	20,06
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,37*	8,82	12,33
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	8,11*	7,90	11,43
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,84*	10,73	14,60
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	12,00*	9,65	11,34
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	17,76*	16,00	21,59
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,64*	9,00	12,49
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	17,76*	13,77	15,66
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	8,27*	8,10	11,77
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,21*	11,55	16,23
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	11,91*	10,69	14,40
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	CHF	11,05*	10,42	14,29
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	USD	11,59*	10,78	14,92
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	17,39*	15,51	20,73

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Emerging Markets Fund				
Total de l'actif net	USD	2.503.464.070	2.246.518.528	3.077.007.312
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	9,41	9,17	13,36
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	36,75	35,65	51,62
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,37	8,41	12,53
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,54	11,19	16,21
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	27,26	26,78	39,27
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	41,90	40,34	57,97
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,60	8,57	12,67
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	32,51	31,69	46,12
Action de distribution (A) de Catégorie I	USD	10,60	10,32	–
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,83	9,13	11,16
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	14,64	14,06	20,15
Action de capitalisation de Catégorie SI	USD	7,58	7,28	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	15,69	14,96	21,27
Emerging Markets Impact Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	92.261.413	84.171.455	28.477.453
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	8,87	8,61	10,06
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,96	7,46	7,31
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	8,55	8,50	10,06
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,35	8,37	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,00	7,47	7,31
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	8,59	8,52	10,07
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	USD	9,80	9,78	–
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,28	10,16	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,07	7,50	7,31
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,99	7,47	7,31
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	10,96	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Emerging Markets Local Currency Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	1.627.879.775	1.417.858.380	2.355.309.356
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	12,24	11,48	14,53
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	3,08	2,90	3,65
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	3,10	2,91	3,67
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	AUD	4,89	4,70	5,98
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	5,08	4,88	6,30
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	6,39	6,12	7,86
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	6,42	6,10	7,85
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	CAD	6,17	5,94	7,67
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	5,69	5,53	7,18
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	62,53	60,23	77,97
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	5,67	5,48	7,09
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	23,24	20,60	24,77
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	6,50	6,03	7,38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,72	6,17	7,58
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	9,60	8,36	9,96
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	79,91	73,31	90,23
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	7,85	7,07	8,54
Action de Catégorie AI de distribution (Q)	USD	9,25	8,66	10,93
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,24	9,96	11,98
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	3,08	2,89	3,65
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	18,89	16,96	20,64
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	12,25	11,49	14,55
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	12,82	12,04	15,17
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en AUD	AUD	4,88	4,70	5,98
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	5,19	4,96	6,31
Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,17	7,39	7,85
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	25,15	22,19	26,54
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	7,93	7,31	8,92
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,01	6,39	7,81
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	PLN	10,15	8,79	10,41
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	8,30	7,44	8,94
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	13,59	12,21	14,74
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	4,77	4,62	5,96
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	21,39	19,06	23,03
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,29	5,80	7,16
Action de Catégorie I de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	–	4,95	6,34
Action de distribution (Q) de Catégorie I	USD	7,73	7,23	9,13
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	25,33	22,31	26,64
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,27	6,62	8,08
Action de distribution (M) de Catégorie S	USD	10,68	–	–
Action de Catégorie S de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	–	7,52	9,57
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	9,91	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,88	–	–
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,44	6,83	7,25
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,19	7,84	9,97
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,66	7,33	7,38
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	9,09	8,29	10,13
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en GBP	GBP	7,63	7,27	9,27
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	7,28	6,38	7,58
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	GBP	9,64	8,60	10,32

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Emerging Markets Sustainable Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	77.515.826	53.883.168	4.894.212
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	7,37	6,95*	9,74
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	7,50	7,01*	9,75
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,50	6,05*	7,07
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	8,85	8,39*	11,81
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,54	6,06*	7,08
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	7,65	7,09*	–
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	NZD	9,93	9,36*	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,66	6,12*	7,09
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	9,43	–	–
ESG Flex Choice Cautious Fund				
Total de l'actif net	USD	9.832.547	11.971.283	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	8,93	9,10	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	AUD	9,08	9,45	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	CAD	9,51	9,76	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	CNH	90,54	95,25	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	9,42	9,75	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	87,76	90,49	–
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	8,53	8,86	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	AUD	8,52	9,08	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	CAD	9,35	9,79	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	CNH	85,15	91,54	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	GBP	9,31	9,79	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	HKD	83,82	88,15	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	8,93	8,92	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,22	9,41	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	CAD	9,70	9,77	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	91,88	94,80	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	9,62	9,76	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	88,95	90,01	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,00	8,96	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,01	8,96	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	9,07	8,99	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
ESG Flex Choice Growth Fund				
Total de l'actif net	USD	12.405.945	14.275.652	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	9,59	8,96	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	AUD	9,74	9,34	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	CAD	10,18	9,62	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	CNH	97,71	94,39	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	10,19	9,73	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	94,30	89,22	–
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	8,62	8,36	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	AUD	8,77	8,79	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	CAD	9,80	9,70	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	CNH	88,33	88,99	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	GBP	9,74	9,69	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	HKD	84,68	83,18	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,31	8,60	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,81	9,29	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	CAD	10,31	9,63	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	98,44	93,95	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	10,19	9,61	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	91,79	85,85	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,39	8,63	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,40	8,64	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	9,46	8,66	–
ESG Flex Choice Moderate Fund				
Total de l'actif net	USD	13.251.957	13.979.090	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	9,36	9,02	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	AUD	9,52	9,39	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	CAD	9,93	9,66	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	CNH	95,40	94,80	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	9,92	9,75	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	92,03	89,79	–
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	8,58	8,52	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	AUD	8,69	8,90	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	CAD	9,62	9,73	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	CNH	87,31	89,95	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	GBP	9,56	9,72	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	HKD	84,39	84,93	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,18	8,72	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,61	9,35	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	CAD	10,08	9,67	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	96,28	94,34	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	9,97	9,66	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	90,81	87,36	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,25	8,75	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,27	8,76	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	9,33	8,78	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
ESG Global Conservative Income Fund				
Total de l'actif net	EUR	367.218.856	644.684.234	648.012.670
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	EUR	8,13	8,74	10,04
Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G)	EUR	8,28	8,88	10,18
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	9,86	10,12	11,19
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G)	EUR	8,35	8,95	10,25
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	9,78	10,04	11,10
Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	EUR	8,34	8,92	10,20
Action de Catégorie D de distribution (Y) (Q) (G)	EUR	–	9,04	10,31
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	10,13	10,34	11,37
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	EUR	8,01	8,64	9,94
Action de Catégorie E de distribution (S) (M) (G)	EUR	8,43	9,03	10,35
Action de Catégorie E de distribution (Y) (Q) (G)	EUR	8,09	8,72	10,04
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	9,64	9,94	11,04
Action de Catégorie I de distribution (Y) (Q) (G)	EUR	–	9,12	10,36
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	10,26	10,45	11,47
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	10,50	10,64	11,62
ESG Global Multi-Asset Income Fund				
Total de l'actif net	USD	167.037.563	158.055.424	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	USD	9,58	9,94	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	8,59	8,91	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	8,20	8,78	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	84,45	88,65	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	8,47	8,89	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,27	9,15	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,42	9,20	–
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	8,21	8,83	–
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,80	9,00	–
Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) couverte en GBP	GBP	8,70	9,03	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	9,53	9,25	–
ESG Multi-Asset Fund				
Total de l'actif net	EUR	6.059.314.393	6.719.550.491	3.576.244.828
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	EUR	10,11	10,78	11,21
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en SGD	SGD	10,46	11,26	11,77
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	USD	10,63	11,33	11,83
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	CNH	86,20	95,76	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en SGD	SGD	8,77	9,55	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en USD	USD	8,90	9,56	–
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	17,99	19,02	19,79
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	10,38	10,88	11,26
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	11,51	12,01	12,34
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	48,89	50,38	51,70
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en ZAR	ZAR	117,85	118,36	116,47
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	11,65	12,32	12,81
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	14,48	15,51	16,34
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en USD	USD	36,01	37,57	39,04
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	19,74	20,76	21,48
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	52,53	53,83	54,94
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	15,92	16,93	17,70
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en USD	USD	43,26	44,80	46,21
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	12,59	13,21	13,64
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	EUR	14,90	14,72	11,76
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	9,94	10,17	10,36

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾				
Total de l'actif net	USD	92.047.171	81.153.606	129.153.843
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	8,83	8,48*	10,14
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,30	8,22*	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,35	8,24*	–
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,21	8,18*	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	8,92	8,53*	10,15
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	AUD	8,68	8,46*	10,15
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,49	8,37*	10,14
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	8,96	8,55*	10,16
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	AUD	8,71	8,48*	10,15
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,53	8,39*	10,14
Euro Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.948.067.126	3.192.055.061	4.309.425.814
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	EUR	23,04	23,68	27,97
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	23,12	20,48	24,08
Action de distribution (D) de Catégorie A	EUR	17,20	17,68	20,88
Action de distribution (M) de Catégorie A	EUR	17,19	17,67	20,87
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	25,70	26,15	30,89
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	JPY	876	916	1.083
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	104,34	100,84	114,65
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	12,45	12,33	14,38
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	8,76	8,92	10,54
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	18,77	19,35	23,14
Action de distribution (A) de Catégorie D	EUR	10,23	10,52	12,42
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	23,26	20,60	24,22
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,65	9,80	11,45
Action de distribution (M) de Catégorie D	EUR	17,28	17,76	20,97
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	27,23	27,61	32,50
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	10,23	10,55	12,47
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	12,94	12,77	14,83
Action de distribution (Q) de Catégorie E	EUR	21,21	21,69	25,75
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	22,73	23,24	27,59
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	8,80	7,79	9,16
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,66	9,82	11,47
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	9,78	9,78	11,41
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	13,14	13,30	15,63
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,15	9,41	11,11
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	903	939	1.105
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	11,05	10,88	12,62
Action de Catégorie S de distribution (A)	EUR	8,83	9,08	10,72
Action de distribution (M) de Catégorie S	EUR	10,12	–	–
Action de capitalisation de Catégorie S	EUR	10,05	–	–
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	8,45	7,37	8,63
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	8,81	8,68	10,08
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	29,81	30,06	35,18

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Euro Corporate Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	2.803.447.684	2.555.209.490	3.289.055.637
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (D) de Catégorie A	EUR	12,29	12,29	14,40
Action de distribution (M) de Catégorie A	EUR	12,06	12,07	14,14
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	15,49	15,27	17,84
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,14	9,15	10,73
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	10,12	9,85	11,39
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	94,85	93,41	108,90
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	10,99	10,55	12,15
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	9,19	9,06	10,59
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	12,04	12,02	14,22
Action de distribution (M) de Catégorie D	EUR	12,06	12,07	14,15
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	16,44	16,15	18,79
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,41	9,39	10,96
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	GBP	10,40	10,08	11,61
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	11,29	10,79	12,39
Action de distribution (Q) de Catégorie E	EUR	12,91	12,79	15,01
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	14,00	13,87	16,29
Action de distribution (Q) de Catégorie I	EUR	9,23	9,21	10,78
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	10,43	10,22	11,87
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,53	9,49	11,06
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	GBP	10,52	10,18	11,71
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	920	926	1.075
Action de Catégorie X de distribution (Q)	EUR	9,10	9,09	10,64
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	17,87	17,45	20,19
Euro Reserve Fund				
Total de l'actif net	EUR	136.303.682	121.337.594	97.877.530
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	72,61	71,34	71,83
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	69,47	68,26	68,72
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	73,24	71,82	72,31
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	68,55	67,52	68,15
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	9,92	9,70	9,76

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Euro Short Duration Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	4.739.565.610	5.402.466.533	8.327.818.672
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	14,01	12,06	12,69
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,85	10,69	11,18
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	11,62	11,33	11,83
Action de distribution (D) de Catégorie A	EUR	11,47	11,46	12,12
Action de distribution (M) de Catégorie A	EUR	11,48	11,47	12,13
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	15,05	14,90	15,76
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,90	9,97	10,57
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	12,49	12,08	12,61
Action de capitalisation de Catégorie A1	EUR	9,52	9,43	9,97
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	11,07	11,10	11,89
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	14,21	12,24	12,84
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	11,06	10,89	11,36
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	11,33	11,04	11,49
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	11,66	10,03	10,53
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,08	9,93	10,36
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	15,90	15,69	16,53
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	10,29	10,32	10,91
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	11,28	10,86	11,30
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	13,40	13,34	14,18
Action de distribution (Q) de Catégorie I	EUR	15,62	15,55	16,37
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	15,92	15,70	16,53
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,43	9,45	9,98
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	11,13	10,71	11,14
Action de Catégorie S de distribution (A)	EUR	10,06	–	–
Action de distribution (M) de Catégorie S	EUR	10,02	–	–
Action de capitalisation de Catégorie S	EUR	10,09	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en USD	USD	10,07	–	–
Action de capitalisation de Catégorie SI	EUR	9,76	9,61	10,11
Action de Catégorie SI de capitalisation couverte en USD	USD	10,55	10,14	10,52
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	16,87	16,57	17,38
Euro-Markets Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.279.240.008	1.301.315.661	1.888.937.995
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	EUR	33,44	28,85	35,32
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	35,99	26,77	32,62
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	38,80	33,36	40,78
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	22,94	19,98	24,38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	18,35	15,55	18,85
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	147,84	124,73	149,75
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	28,10	23,83	28,71
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	20,99	17,50	20,90
Action de capitalisation de Catégorie A1	EUR	13,62	11,70	14,31
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	28,72	25,00	30,94
Action de distribution (A) de Catégorie D	EUR	33,79	29,14	35,71
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	33,80	25,13	30,65
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	44,29	37,79	45,85
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	19,72	16,31	19,34
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	44,29	32,57	39,34
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	20,61	17,82	21,57
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	34,45	29,77	36,57
Action de distribution (A) de Catégorie I	EUR	15,51	13,38	16,40
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	44,64	37,99	45,97
Action de Catégorie S de distribution (A)	EUR	12,65	10,91	13,37
Action de capitalisation de Catégorie S	EUR	13,41	11,43	13,84
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	49,15	41,51	49,86

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
European Equity Income Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.565.481.371	1.788.035.472	2.149.181.806
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	EUR	15,11	14,49	16,57
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	EUR	14,35	13,78	15,86
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en USD	USD	22,62	21,09	23,81
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	11,07	10,62	12,06
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	CAD	9,02	8,63	9,77
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	95,51	92,71	104,70
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	9,03	8,64	9,76
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	USD	10,08	9,56	10,75
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	EUR	10,77	10,34	11,80
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	14,06	13,31	15,03
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	194,37	183,15	206,24
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	12,16	11,50	12,94
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	USD	12,78	11,89	13,32
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	24,53	22,56	24,74
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	17,75	15,85	17,07
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	24,54	19,44	21,23
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G)	EUR	10,86	10,43	12,00
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	13,07	12,02	13,18
Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	EUR	14,42	13,72	15,58
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	14,42	11,83	13,36
Action de Catégorie D de distribution (M) (G)	EUR	9,18	-	-
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	14,40	11,83	13,45
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	13,57	12,76	14,44
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	9,72	9,12	10,18
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	USD	10,95	10,11	11,24
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	26,77	24,44	26,60
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	26,78	21,06	22,82
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	16,10	14,27	15,25
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	EUR	13,54	13,07	15,11
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	23,08	21,34	23,52
Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	EUR	14,63	13,89	15,72
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	13,95	12,70	13,79
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	13,95	10,94	11,83
Action de Catégorie SR de distribution (A) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	9,88	8,08	9,12
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,93	8,58	9,29
Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	15,90	12,94	14,56
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	18,11	16,37	17,64
European Focus Fund				
Total de l'actif net	EUR	340.081.012	326.098.002	452.090.412
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	34,62	29,70	38,77
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	27,59	23,34	30,03
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	20,76	17,27	22,05
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	15,33	13,15	17,16
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	28,12	24,43	32,29
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	38,81	33,05	42,80
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	38,81	28,47	36,72
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	31,88	27,49	36,05
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	39,44	33,49	43,27

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
European Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.337.429.488	1.220.902.141	1.866.977.485
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	EUR	160,08	137,36	178,61
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	160,84	118,94	153,96
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	172,36	147,74	192,10
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	18,75	15,93	20,62
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	CAD	18,44	15,48	19,87
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	174,24	149,33	187,39
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	17,39	14,70	18,96
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	26,89	22,63	28,94
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	NZD	19,77	16,62	21,45
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	20,70	17,51	22,44
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	28,30	23,52	29,91
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	126,41	109,71	144,46
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	164,01	121,23	156,11
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	196,75	167,39	216,02
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	27,05	22,31	28,17
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	196,75	144,26	185,32
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	152,64	131,49	171,83
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	199,23	169,06	217,62
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	USD	21,75	17,89	22,53
Action de capitalisation de Catégorie S	EUR	15,94	13,54	17,44
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	219,61	184,96	236,31
European High Yield Bond Fund				
Total de l'actif net	EUR	320.732.466	301.180.428	363.644.142
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	11,81	11,23	12,86
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	11,30	10,91	12,52
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	117,20	111,35	127,61
Action de distribution (A) de Catégorie D	EUR	8,91	8,86	10,54
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,43	9,26	10,91
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	12,33	11,67	13,32
Action de distribution (Q) de Catégorie E	EUR	8,98	8,93	10,56
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	11,36	10,85	12,49
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	13,08	12,29	13,92
Action de capitalisation de Catégorie Z	EUR	10,14	9,57	10,88
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en USD	USD	9,72	8,93	–
European Special Situations Fund				
Total de l'actif net	EUR	1.238.974.055	1.127.016.712	1.667.223.264
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	EUR	9,78	8,47	11,16
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	59,34	51,36	67,59
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	21,84	18,74	24,56
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	CAD	21,47	18,21	23,67
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	514,22	445,08	566,44
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	20,10	17,16	22,39
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	160,57	136,40	176,53
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	24,95	20,94	26,97
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	46,33	40,60	54,11
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	67,71	58,17	75,98
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	24,14	20,11	25,71
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	54,04	47,00	62,17
Action de distribution (A) de Catégorie I	EUR	12,59	10,91	14,28
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	18,37	15,74	20,50
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	18,51	15,74	20,35

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
European Sustainable Equity Fund				
Total de l'actif net	EUR	5.573.525	4.831.817	5.724.517
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	10,05	9,12	11,27
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	8,99	8,15	10,08
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,24	7,94	9,68
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	8,91	8,11	10,07
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,30	7,95	9,69
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,45	8,02	9,70
Action de capitalisation de Catégorie ZI	EUR	10,49	-	-
European Value Fund				
Total de l'actif net	EUR	724.576.156	773.465.607	959.233.726
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	EUR	63,29	55,17	60,01
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	67,62	50,79	55,00
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	88,30	75,80	80,77
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	17,03	14,48	15,31
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	175,98	150,46	154,76
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	168,92	142,50	149,51
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	17,77	14,81	15,46
Action de capitalisation de Catégorie C	EUR	62,19	54,05	58,33
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	67,62	50,77	55,01
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	99,40	84,68	89,57
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	USD	19,38	16,03	16,61
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	79,80	68,84	73,73
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	21,23	18,04	19,03
Action de Catégorie S de distribution (A)	EUR	11,53	10,04	10,93
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	14,60	12,31	12,89
FinTech Fund				
Total de l'actif net	USD	255.313.096	415.642.180	857.029.862
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	5,46	4,88	7,21
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	10,81	11,21	19,69
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,35	10,06	18,34
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	10,18	10,74	19,13
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,88	12,32	21,62
Action de Catégorie C de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	5,32	4,82	7,21
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	11,26	11,58	20,18
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,74	10,40	18,79
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,27	9,98	14,64
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,11	10,65	18,97
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	13,55	14,12	24,92
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,12	9,86	18,05
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	5,57	4,94	7,23
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	11,41	11,70	20,33
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,24	11,96	21,57
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	11,80	12,03	20,75
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,44	10,10	14,77

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Fixed Income Global Opportunities Fund				
Total de l'actif net	USD	7.224.434.913	8.997.090.506	10.990.274.596
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	9,44	9,65	10,43
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	EUR	8,24	8,64	9,48
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	9,60	9,81	10,59
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	USD	9,97	–	–
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	9,59	9,80	10,58
Action de distribution (Q) de Catégorie A	USD	9,63	9,82	10,60
Action de Catégorie A de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	6,08	6,37	6,98
Action de Catégorie A de distribution (Q) couverte en SGD	SGD	13,53	13,97	15,10
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	8,22	8,49	9,35
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	85,40	89,54	98,44
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	10,90	11,18	12,27
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	80,63	83,78	92,45
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	14,92	14,81	15,79
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,27	9,59	10,39
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,46	9,64	10,43
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	JPY	979	1.023	1.103
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	16,79	16,22	16,91
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	97,45	99,10	106,80
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	21,02	21,10	22,52
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,32	10,36	11,09
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,85	11,76	12,53
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,64	9,83	10,63
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	9,60	9,80	10,59
Action de distribution (Q) de Catégorie C	USD	9,58	9,77	10,55
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	12,14	12,20	13,17
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	12,78	13,06	14,11
Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en CAD	CAD	9,12	9,37	10,15
Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	EUR	8,23	8,64	9,48
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	4,31	4,46	4,84
Action de distribution (Q) de Catégorie D	USD	10,12	10,33	11,15
Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en CHF	CHF	8,11	8,63	9,47
Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	6,09	6,39	7,00
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	15,73	15,54	16,48
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	10,15	10,45	11,26
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,23	10,37	11,17
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	GBP	11,39	11,38	12,11
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	PLN	17,73	17,04	17,67
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	22,18	22,16	23,53
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	13,70	13,66	14,63
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,71	8,93	9,71
Action de Catégorie I de distribution (M) couverte en CAD	CAD	9,02	9,27	10,03
Action de distribution (Q) de Catégorie I	USD	9,42	9,62	10,38
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	8,07	8,46	9,27
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en GBP	GBP	9,22	9,52	10,32
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en JPY	JPY	839	903	985
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	12,59	12,41	13,15
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	AUD	10,47	10,49	11,17
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	CAD	11,56	11,46	12,15
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	CHF	10,88	11,19	12,04
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,61	10,74	11,55
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	GBP	11,56	11,52	12,25
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	1.043	1.084	1.160
Action de distribution (M) de Catégorie J	USD	9,60	9,80	10,59
Action de Catégorie S de distribution (A) couverte en EUR	EUR	8,86	9,30	10,21
Action de Catégorie S de distribution (Q)	USD	9,69	9,89	10,68
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	10,73	10,59	11,22
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,67	9,95	10,71
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,89	10,02	10,78
Action de Catégorie X de distribution (M)	USD	9,60	9,80	10,59

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Action de Catégorie X de distribution (M) couverte en AUD	AUD	9,67	10,03	10,90
Action de Catégorie X de distribution (M) couverte en EUR	EUR	8,13	8,53	9,36
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	8,35	8,75	9,59
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en GBP	GBP	8,73	9,01	9,76
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	12,48	12,24	12,90
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	AUD	12,57	12,52	13,27
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CAD	CAD	11,83	11,67	12,32
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF	CHF	11,44	11,70	12,54
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,37	11,47	12,27
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	GBP	11,58	11,50	12,16
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK	SEK	10,74	10,79	11,49
Future Consumer Fund				
Total de l'actif net	USD	12.941.231	11.978.939	20.285.571
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	5,92	5,65	10,05
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	7,02	6,70	11,92
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	6,04	5,71	10,08
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	6,04	4,92	7,31
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	7,16	6,86	12,27
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	6,06	5,72	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	6,07	4,94	7,31
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	6,16	4,98	7,33
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	6,07	5,73	10,08
Future Of Transport Fund				
Total de l'actif net	USD	1.828.120.719	1.603.226.338	1.753.241.623
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	8,79	8,21	–
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,78	7,08	7,54*
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	10,82	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	14,63	13,69	17,32*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	83,05	80,06	99,99*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,75	12,35	16,09*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	13,73	13,07	16,72*
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	17,97	16,82	21,27*
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	10,30	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,28	12,76	16,49*
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	15,25	12,19	12,89*
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	13,72	13,05	16,68*
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	18,80	17,69	22,49*
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,44	12,11	15,86*
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,90	7,15	7,55*
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	15,43	14,28	17,88*
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	15,71	15,06	19,41*
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	15,98	14,69	18,26*
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	15,49	12,34	13,01*

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Global Allocation Fund				
Total de l'actif net	USD	14.455.276.896	15.096.811.718	18.768.461.196
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	66,57	63,93	75,92
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	EUR	36,67	36,38	44,14
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	9,70	–	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	AUD	9,67	–	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	CNH	96,47	–	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en EUR	EUR	9,68	–	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	HKD	96,95	–	–
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en SGD	SGD	9,68	–	–
Action de Catégorie A de distribution (R) couverte en ZAR	ZAR	96,84	–	–
Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G)	USD	8,55	8,35	10,08
Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G) couverte en AUD	AUD	8,23	8,23	10,08
Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G) couverte en SGD	SGD	8,37	8,30	10,08
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	69,23	65,75	78,08
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	19,34	18,80	22,63
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	12,86	12,78	15,48
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	158,80	155,43	181,94
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	39,90	39,15	47,51
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	33,73	32,64	39,18
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	16,21	15,58	18,62
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	20,13	18,74	22,05
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	15,76	15,20	18,15
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	13,80	13,12	15,57
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,10	10,89	13,22
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	50,61	48,68	58,53
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	29,19	29,00	35,63
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	67,03	64,35	76,44
Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	EUR	36,88	36,59	44,42
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	77,93	73,47	86,59
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	AUD	20,99	20,25	24,19
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	13,97	13,78	16,57
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	44,92	43,75	52,69
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	GBP	36,58	35,14	41,86
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	PLN	21,86	20,20	23,58
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	17,20	16,46	19,51
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	77,94	63,29	62,83
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	62,21	59,38	70,87
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	37,36	36,84	44,93
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en PLN	PLN	18,89	17,67	20,89
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	78,37	73,72	86,71
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	44,72	43,46	52,23
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SGD	SGD	17,23	16,50	19,60
Action de capitalisation de Catégorie J	USD	91,23	85,18	99,43
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	10,03	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,99	–	–
Action de distribution (A) de Catégorie X	USD	14,81	14,21	16,90
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	90,62	84,61	98,78
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	AUD	24,17	23,10	27,33
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,37	12,89	15,38
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY	JPY	1.314	1.299	1.535

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Global Corporate Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	878.806.860	801.859.454	1.425.677.563
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	EUR	7,49	7,81	9,47
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	USD	9,92	–	–
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	AUD	10,30	10,62	12,74
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CAD	CAD	9,67	9,86	11,77
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	GBP	9,07	9,31	11,15
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	NZD	10,60	10,82	12,91
Action de distribution (Q) de Catégorie A	USD	9,92	10,01	11,93
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	9,32	9,54	11,56
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	84,53	88,35	106,93
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	8,22	8,41	10,18
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	9,49	9,63	11,63
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	69,28	71,28	86,62
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	8,24	8,48	10,26
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	13,93	13,69	16,10
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,56	11,70	13,98
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	93,05	94,01	111,88
Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en GBP	GBP	8,97	9,18	10,98
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	14,88	14,56	17,05
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,34	12,44	14,78
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,57	9,51	11,17
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	12,85	12,70	15,00
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,71	10,89	13,07
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,66	8,90	10,68
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	11,48	11,22	13,11
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	CAD	11,12	10,94	12,81
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,38	9,44	11,20
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,03	8,30	9,99
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	16,20	15,75	18,33
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,46	13,49	15,93
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	NOK	103,99	103,29	120,40
Global Dynamic Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	408.930.589	453.941.160	512.958.953
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	28,90	26,33	31,94
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	28,98	26,41	32,03
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	181,27	170,30	204,17
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	16,98	16,03	19,95
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	23,31	21,50	26,42
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,94	13,32	16,79
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	26,48	24,12	29,17
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	32,50	29,39	35,39
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	18,42	17,26	21,33
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	26,55	24,31	29,64
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	15,87	15,06	18,84
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	11,51	10,38	12,47
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	38,67	34,59	41,19

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Global Equity Income Fund				
Total de l'actif net	USD	919.175.375	939.683.090	1.055.991.438
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	USD	14,77	13,65	16,23
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR	EUR	10,40	9,97	12,14
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	USD	14,71	13,62	16,17
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	11,42	10,97	13,33
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD	SGD	13,29	12,52	14,97
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	14,70	11,72	11,72
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	11,28	10,62	12,78
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	114,54	109,19	130,72
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	ZAR	119,76	111,20	132,38
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	14,89	13,79	16,41
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	CNH	115,62	110,32	129,51
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	111,04	104,06	124,57
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	11,28	10,63	12,74
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	10,96	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	21,38	19,29	22,41
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	12,14	11,49	13,62
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	16,22	15,19	18,05
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	21,92	19,50	22,53
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	18,61	17,10	19,99
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	9,86	9,47	11,51
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	13,84	12,50	14,51
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,03	10,33	12,28
Action de Catégorie C de distribution (Q) (G)	USD	12,01	11,25	13,53
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	17,25	15,76	18,53
Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	USD	17,29	15,86	18,73
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G)	USD	15,97	14,67	17,30
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	12,40	11,81	14,26
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	15,99	12,65	12,56
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,71	8,19	9,79
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	23,53	21,07	24,29
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	15,53	14,58	17,16
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	17,60	16,35	19,30
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	PLN	23,79	21,00	24,09
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	20,19	18,40	21,36
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	USD	13,86	12,89	15,38
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	10,46	10,10	12,34
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	20,09	18,22	21,27
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,52	9,90	11,83
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	16,21	14,48	16,65
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	16,21	–	–
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G)	USD	9,97	9,13	–
Action de capitalisation de Catégorie SR	USD	10,29	9,20	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	26,79	23,77	27,12

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Global Government Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	1.019.444.419	845.281.585	779.645.367
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	19,04*	19,94	22,81
Action de Catégorie A de distribution (D) couverte en EUR	EUR	15,51*	16,70	19,39
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	19,07*	19,96	22,83
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	EUR	15,38*	16,55	19,22
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	GBP	8,55*	9,07	10,41
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en HKD	HKD	88,02*	93,31	107,33
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	27,90*	28,65	32,63
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	22,37*	23,61	27,29
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	17,33*	18,15	20,93
Action de Catégorie C de distribution (D) couverte en EUR	EUR	14,29*	15,38	18,00
Action de distribution (M) de Catégorie C	USD	18,47*	19,34	22,09
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	20,40*	21,21	24,46
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	16,39*	17,51	20,50
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	19,08*	19,98	22,86
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en EUR	EUR	15,40*	16,60	19,28
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	29,23*	29,90	33,94
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	23,72*	24,95	28,74
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	24,78*	25,57	29,27
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	19,79*	20,99	24,39
Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	EUR	8,37*	9,02	10,48
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,36*	10,58	11,99
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,32*	8,74	10,05
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,83*	10,28	11,77
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	NOK	98,03*	101,75	114,79
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK	SEK	91,20*	95,22	108,50
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,50*	9,21	8,75

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Global High Yield Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	1.663.910.586	1.694.518.231	2.572.901.253
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (D) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,06	6,06	6,10
Action de Catégorie A de distribution (D) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	4,25	4,36	5,30
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	7,09	7,06	8,45
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	EUR	4,20	4,30	5,24
Action de distribution (Q) de Catégorie A	USD	11,01	10,95	13,08
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	5,49	5,54	6,80
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	ZAR	75,10	75,53	91,97
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	CNH	84,62	88,07	107,73
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	5,71	5,76	7,03
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	42,15	43,13	52,97
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	7,83	8,02	9,83
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	27,22	25,79	29,69
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	16,32	15,92	18,65
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	18,42	17,70	20,53
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	15,27	14,13	15,98
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	13,01	12,66	14,82
Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	8,41	8,61	10,48
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,81	9,57	11,21
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	7,23	7,21	8,61
Action de Catégorie C de distribution (D) couverte en EUR	EUR	–	–	5,42
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	22,33	21,42	24,97
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,30	12,15	14,41
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	7,13	7,10	8,49
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en EUR	EUR	4,22	4,33	5,27
Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en GBP	GBP	7,67	7,74	9,32
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	29,82	28,05	32,07
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	17,81	17,25	20,07
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	19,98	19,06	21,95
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	8,40	8,60	10,46
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	24,12	22,96	26,57
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	14,46	14,17	16,69
Action de Catégorie I de distribution (M)	USD	9,23	9,19	10,99
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	30,22	28,38	32,39
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	CAD	13,17	12,46	14,28
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,37	10,03	11,65
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	8,84	8,66	10,06
Action de Catégorie X de distribution (A) couverte en EUR	EUR	7,19	7,37	9,02
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	12,12	11,32	12,85
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	20,82	20,03	23,14
Global Inflation Linked Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	270.286.414	364.440.108	373.611.254
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	15,33	15,77	16,40
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	15,80	16,25	16,90
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,16	13,93	14,69
Action de distribution (M) de Catégorie C	USD	13,10	13,64	14,36
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	13,09	13,63	14,36
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	15,49	15,93	16,52
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	16,61	17,02	17,63
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,84	14,60	15,33
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,27	13,05	13,83
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,89	10,11	10,47
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	15,18	15,92	16,63

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Global Long-Horizon Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	1.385.067.852	1.063.272.581	1.092.916.141
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	21,15	19,24	23,75*
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	31,91	25,00	26,00*
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	86,40	78,59	97,03*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	19,85	18,38	22,90*
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	16,62	15,12	18,67*
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	63,91	58,86	73,60*
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	33,07	25,72	26,55*
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	94,21	85,05	104,23*
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	76,64	70,06	86,94*
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,83	9,74	11,91*
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	15,24	13,62	16,52*
Global Multi-Asset Income Fund				
Total de l'actif net	USD	4.840.876.377	5.435.956.493	7.295.326.620
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	USD	8,22	8,47	10,15
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en CHF	CHF	6,95	7,49	9,16
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR	EUR	6,39	6,79	8,30
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	USD	8,50	8,74	10,43
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	USD	8,52	8,77	10,45
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en AUD	AUD	7,84	8,24	9,92
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD	SGD	7,23	7,55	9,03
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	7,68	7,94	9,57
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	CAD	7,23	7,48	9,00
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	79,12	83,76	100,41
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en GBP	GBP	7,25	7,47	9,00
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	7,42	7,64	9,18
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	7,88	8,13	9,74
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	6,28	6,70	8,18
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	74,50	77,81	93,85
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	7,18	7,52	9,05
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	14,52	14,11	16,05
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	10,36	10,52	12,20
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,33	10,35	11,99
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	7,80	8,28	10,06
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,69	9,71	11,25
Action de Catégorie C de distribution (S) (M) (G)	USD	7,92	8,15	9,76
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	11,39	11,21	12,91
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en CHF	CHF	7,42	7,93	9,60
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en EUR	EUR	7,22	7,60	9,20
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	USD	8,63	8,81	10,47
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	GBP	7,91	8,21	9,82
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	9,38	9,67	-
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	15,42	14,84	16,74
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	11,04	11,11	12,77
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,18	11,10	12,75
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	6,28	6,70	8,18
Action de Catégorie E de distribution (Y) (Q) (G) couverte en EUR	EUR	6,75	7,21	8,80
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	16,43	16,05	18,34
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,86	9,93	11,56
Action de Catégorie I de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	7,21	7,57	9,10
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	12,94	12,44	14,00
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,28	10,18	11,67
Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) couverte en GBP	GBP	8,70	8,95	10,56
Action de Catégorie X de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	8,66	8,84	10,48
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	17,61	16,83	18,82

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Impact Bond Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	EUR	76.299.304	-	-
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,08	-	-
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,13	-	-
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	9,95	-	-
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,14	-	-
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,17	-	-
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	10,42	-	-
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,14	-	-
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	EUR	10,16	-	-
India Fund				
Total de l'actif net	USD	469.753.593	451.125.592	433.709.278
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	48,73	40,39	37,31
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	48,47	46,64	51,14
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	38,25	37,27	41,38
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	52,81	43,45	39,83
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	54,88	52,41	57,05
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	44,45	42,98	47,37
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,34	8,90	-
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	18,14	17,15	18,48
Japan Flexible Equity Fund				
Total de l'actif net	JPY	35.030.142.165	29.089.575.077	20.433.042.222
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	JPY	2.347	11,75	13,14
Action de capitalisation de Catégorie A	JPY	2.388	1.923	2.016
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	14,26	11,30	12,09
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	25,17	19,40	20,30
Action de capitalisation de Catégorie C	JPY	1.897	1.546	1.642
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	JPY	2.394	11,97	13,40
Action de capitalisation de Catégorie D	JPY	2.696	2.154	2.241
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	15,48	12,18	12,93
Action de capitalisation de Catégorie E	JPY	2.187	1.770	1.864
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,16	10,48	11,26
Action de capitalisation de Catégorie I	JPY	2.202	1.755	1.821
Action de capitalisation de Catégorie X	JPY	3.025	2.393	2.465
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	18,23	14,21	14,93
Japan Small & MidCap Opportunities Fund				
Total de l'actif net	JPY	21.455.088.138	20.235.105.162	24.894.954.371
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	JPY	9.306	52,01	60,36
Action de capitalisation de Catégorie A	JPY	9.347	8.391	9.138
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	58,36	51,50	57,02
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	USD	19,34	16,62	18,00
Action de capitalisation de Catégorie C	JPY	6.871	6.246	6.887
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	JPY	9.584	53,51	62,08
Action de capitalisation de Catégorie D	JPY	10.519	9.373	10.131
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	63,33	55,47	60,95
Action de capitalisation de Catégorie E	JPY	8.266	7.458	8.163
Action de capitalisation de Catégorie I	JPY	2.126	1.890	2.037
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,33	9,90	10,85
Action de capitalisation de Catégorie X	JPY	11.529	10.170	10.882

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Latin American Fund				
Total de l'actif net	USD	936.624.325	835.233.169	882.654.961
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	59,38	49,60	59,01
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	58,45	42,06	42,15
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	71,09	57,12	63,53
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,78	8,05	9,14
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	5,86	4,89	5,59
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	9,31	7,57	8,46
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	8,86	6,99	7,80
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	6,47	5,25	5,90
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	51,63	42,01	47,31
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	59,26	49,46	58,87
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	58,31	41,93	42,02
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	80,63	64,31	70,99
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	6,35	5,26	5,96
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	51,14	42,06	47,56
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	PLN	9,62	7,53	8,35
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	7,03	5,66	6,30
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	44,23	35,82	40,19
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	63,97	51,67	57,75
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	12,33	9,80	10,79
Action de capitalisation de Catégorie J	USD	100,44	79,11	86,22
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	57,56	41,34	41,46
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	93,80	73,87	80,51
Multi-Theme Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	164.246.119	188.867.921	170.206.315
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	12,52	11,91	14,69
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,82	10,66	13,47
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	14,17	13,48	16,61
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	10,64	10,25	12,80
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,04	10,80	13,55
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	12,79	10,41	10,74
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	13,94	13,33	16,51
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	13,11	12,29	14,93
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	GBP	9,31	8,94	11,03
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	12,89	12,15	14,84
Natural Resources Fund⁽⁷⁾				
Total de l'actif net	USD	376.671.068	444.508.211	200.835.144
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	USD	8,76	8,44	7,42
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	USD	14,24	13,72	12,07
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	USD	8,53	8,22	7,26
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	13,01	12,12	10,31
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,24	12,81	11,09
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	10,74	9,93	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,72	13,18	11,33
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	6,67	6,71	6,07
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	12,26	11,48	9,81
Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	USD	12,83	12,23	10,65
Action de Catégorie S de distribution (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	12,32	–	–
Action de Catégorie S de distribution (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,83	–	–
Action de Catégorie S de distribution (Q) (G)	USD	10,74	–	–
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	10,99	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,99	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,96	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Next Generation Health Care Fund				
Total de l'actif net	USD	18.371.129	16.685.032	21.045.921
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	8,01	7,50	10,37
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	78,58	74,53	103,69
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	7,82	7,45	10,37
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	9,46	8,86	12,25
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	8,16	7,58	10,39
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,16	6,53	7,54
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	9,65	9,08	12,62
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	8,20	7,60	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,20	6,55	7,55
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,33	6,61	7,56
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	8,21	7,61	10,40
Next Generation Technology Fund				
Total de l'actif net	USD	2.565.516.420	2.755.606.835	6.005.476.165
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	5,87	5,59	–
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	5,87	4,82	7,33
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	11,15	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	15,73	14,99	27,08
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	8,24	8,08	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	57,66	56,81	101,91
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,73	13,54	25,39
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	57,36	55,32	100,71
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	NZD	8,40	8,15	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	14,84	14,39	26,40
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	5,84	5,84	10,84
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	6,02	5,88	10,87
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	17,66	16,84	30,41
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	10,87	–	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	16,39	15,50	27,77
Action de capitalisation de Catégorie D couverte en CNH	CNH	58,86	57,51	102,33
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	14,31	13,99	26,03
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	5,63	5,42	9,86
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	16,40	13,35	20,15
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	14,89	14,43	26,46
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	20,87	20,00	36,31
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,40	13,28	25,03
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,21	7,49	11,27
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	16,61	15,66	27,99
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	17,43	17,01	31,55
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	16,61	13,49	20,31
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	6,40	6,05	10,83
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	5,97	5,91	10,88
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	5,93	5,80	10,77
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	6,15	5,96	10,91
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	6,49	5,28	7,97
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	6,50	5,29	7,97
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	5,93	5,79	10,77
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	17,17	16,08	28,55
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	16,64	13,52	20,33
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	6,00	5,93	10,89

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Nutrition Fund				
Total de l'actif net	USD	270.316.503	348.357.484	348.777.115
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	EUR	10,46*	11,52	15,16*
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,21*	6,61	7,16*
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,91*	11,87	15,46*
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	13,26*	14,11	18,15*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,54*	11,63	15,29*
Action de Catégorie A de capitalisation en HKD	HKD	13,38*	14,24	18,18*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	10,61*	11,11	14,18*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	11,99*	12,97	16,80*
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,37*	12,10	15,56*
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	11,20*	12,06	15,71*
Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	EUR	10,97*	12,07	15,74*
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	11,44*	12,42	16,05*
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	14,72*	15,53	19,81*
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,63*	12,73	16,61*
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	13,04*	14,00	17,98*
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	7,94*	8,57	11,07*
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	12,40*	13,26	17,13*
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,30*	6,68	7,17*
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	14,99*	15,78	20,08*
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	972*	1.083	1.396*
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	10,83*	11,32	14,31*
Sustainable Asian Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	112.231.546	42.880.627	21.022.396
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	7,54	7,92	9,99
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	8,56	8,60	10,37
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	8,70	8,68	10,41
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,23	8,47	10,33
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,90	8,20	10,11
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	8,54	8,51	10,19
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	SEK	83,56	85,63	103,69
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	8,86	8,79	10,47
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	8,75	8,71	10,43
Action de Catégorie ZI de distribution (S) (M) (G)	USD	10,19	–	–
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	10,62	–	–
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	42.797.310	43.855.487	73.427.244
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,56	8,77	11,12
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,37	7,95	10,31
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,38	10,44	13,24
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,25	8,78	11,39
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	8,56	8,16	10,46
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,70	8,20	10,55
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,93	7,80	8,26
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	7,73	7,64	10,19
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,59	8,20	10,69
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,49	9,54	11,99
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,23	8,68	11,16
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	10,41	9,40	11,72
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	12,21	9,53	10,05
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	11,78	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Sustainable Emerging Markets Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	216.059.158	352.748.965	551.521.515
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,52	6,43	7,32
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	SGD	7,34	7,40	10,02
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	10,17	9,52	12,20
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,98	8,70	11,39
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,64	10,89	13,97
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,39	9,11	11,91
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,63	6,49	7,34
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,09	8,86	11,50
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,25	8,91	11,59
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,54	8,45	9,06
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,46	8,01	10,28
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	7,78	7,84	10,61
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,01	8,78	11,54
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,87	10,10	12,85
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,59	9,23	11,98
Action de capitalisation de Catégorie I couverte en NOK	NOK	104,34	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	10,99	10,15	12,82
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,37	8,84	11,31
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,39	8,02	10,35
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	11,56	–	–
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	53.127.013	79.198.715	102.229.816
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	10,29	10,05*	11,93
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,22	9,26*	11,19
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	84,71	84,99*	102,55
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,49	11,21*	13,31
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,66	9,72*	11,75
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,35	9,46*	11,35
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,55	9,54*	11,45
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,75	8,98*	8,92
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	7,95	8,32*	10,35
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,04	9,14*	11,11
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,88	10,54*	12,40
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,72	9,69*	11,61
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	11,27	10,83*	12,65
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	10,98	–	–
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	506.884.997	429.926.735	424.563.728
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,87	8,58	10,43
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,66	7,79	9,68
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	12,42	10,80	13,13
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,40	9,35	11,62
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	8,71	7,89	9,73
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,88	7,95	9,84
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,11	7,54	7,68
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	7,93	7,52	9,73
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,50	8,59	10,73
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	11,39	9,84	11,89
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,65	8,62	10,65
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	10,46	8,99	10,80
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	12,31	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Sustainable Energy Fund				
Total de l'actif net	USD	6.939.857.910	6.450.497.616	7.380.570.724
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	16,35	14,62	18,27
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	16,39	12,62	13,29
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	11,74	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	16,53	14,78	18,47
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,67	8,87	11,36
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	CAD	9,92	8,99	11,37
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	100,90	92,92	114,80
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	14,83	13,74	17,65
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	9,77	8,94	11,37
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	99,98	90,41	113,69
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	NZD	9,85	8,94	11,38
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	17,00	15,46	19,52
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	19,18	17,14	21,42
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	12,61	11,41	14,44
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	16,99	15,13	18,77
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	17,27	13,25	13,84
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	18,90	16,77	20,80
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	8,80	7,95	–
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	14,80	13,30	16,70
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,36	8,72	11,26
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,50	7,29	7,62
Action de distribution (Q) de Catégorie I	USD	11,27	10,03	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	18,93	16,76	20,73
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	18,93	14,44	15,04
Action de Catégorie S de distribution (A)	USD	10,43	–	–
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	18,33	16,22	20,09
Action de Catégorie X de distribution (T)	USD	10,81	10,19	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	22,82	20,01	24,54
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	16,85	15,31	19,30
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund				
Total de l'actif net	EUR	506.773.855	565.937.527	1.063.687.951
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	EUR	9,57*	9,74	10,66
Action de capitalisation de Catégorie AI	EUR	9,55*	9,72	10,64
Action de capitalisation de Catégorie D	EUR	9,72*	9,85	10,72
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,48*	9,75	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	9,48*	9,35	10,04
Action de capitalisation de Catégorie E	EUR	9,39*	9,61	10,57
Action de capitalisation de Catégorie I	EUR	9,77*	9,88	10,74
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	JPY	935*	972	–
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	SEK	92,15*	93,15	101,03
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	USD	9,51*	9,37	10,04
Action de Catégorie X de distribution (M)	EUR	8,66*	9,06	10,06
Action de Catégorie X de distribution (Q)	EUR	8,91*	9,32	10,33
Action de capitalisation de Catégorie X	EUR	9,94*	10,00	10,82
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,72*	9,94	10,77
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	GBP	10,26*	10,18	10,90
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY	JPY	976*	1.009	1.087
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK	SEK	99,90*	100,49	108,45
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD	USD	10,47*	10,26	10,94
Action de capitalisation de Catégorie ZI	EUR	10,26*	–	–
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en USD	USD	10,49*	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	USD	95.921.193	–	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,01	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	SEK	102,52	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,16	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	10,87	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,23	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	10,93	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,04	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	10,82	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,25	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	10,96	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,32	–	–
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,27	–	–
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	10,97	–	–
Sustainable Global Bond Income Fund				
Total de l'actif net	USD	111.365.913	120.102.371	144.156.163
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	USD	9,97	–	–
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	CNH	82,99	86,69	100,08
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	8,33	8,50	9,82
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en AUD	AUD	7,89	8,19	9,55
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CAD	CAD	8,11	8,32	9,64
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	7,58	7,96	9,35
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	7,92	8,18	9,50
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	HKD	81,13	83,82	97,56
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en NZD	NZD	8,09	8,30	9,59
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	SGD	8,05	8,32	9,63
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	10,49	10,19	11,25
Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	8,18	8,49	9,75
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	11,39	11,06	12,22
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,31	9,30	10,43
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	10,76	10,39	11,42
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,39	9,46	10,57
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,61	9,55	10,67
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,14	9,92	10,95
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	EUR	8,08	8,39	9,63
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,15	9,18	10,35
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	8,53	8,89	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,85	10,47	11,49
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	USD	9,73	8,36	8,48
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,76	9,67	10,78
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	9,70	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	11,13	10,68	11,67
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	10,91	10,52	11,53
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,60	9,64	10,75
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,84	9,74	10,85
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	10,69	–	–
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,44	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Sustainable Global Infrastructure Fund				
Total de l'actif net	USD	11.642.448	10.453.305	10.522.975
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,41	9,44	10,47
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	10,64	10,68	11,85
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,52	9,50	10,48
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	10,52	10,62	11,84
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,84	10,78	11,85
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	9,71	9,60	10,50
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	9,59	9,54	10,49
Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾				
Total de l'actif net	USD	925.326.117	1.128.318.997	1.365.246.053
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	51,60	53,53	61,89
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	51,46	53,40	61,73
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	86,01	92,36	108,18
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	8,55	9,05	10,60
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	75,25	76,31	86,91
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	166,93	174,06	201,30
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,76	11,05	12,63
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	51,87	53,81	62,21
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	51,52	53,45	61,80
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	80,32	81,12	92,02
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,00	9,49	10,95
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	174,16	180,88	208,35
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,96	11,21	12,76
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	68,35	69,66	79,74
Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	EUR	8,38	8,94	10,51
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,48	10,57	11,97
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	87,99	88,33	99,59
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF	CHF	12,97	13,59	15,57
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en DKK	DKK	108,37	111,26	125,88
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	187,56	193,62	221,67
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	GBP	12,06	12,26	13,88
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	NOK	12,94	13,25	14,96
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	NZD	11,53	11,65	13,12
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund⁽⁵⁾				
Total de l'actif net	CHF	600.743.262	707.399.037	1.067.455.859
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	CHF	595,61	572,12	781,90
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	CHF	21,00	17,68	21,69
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	CHF	666,78	559,15	685,75
Action de capitalisation de Catégorie I	CHF	33,10	31,48	42,59

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Systematic China A-Share Opportunities Fund				
Total de l'actif net	USD	548.123.752	562.981.457	618.523.841
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	10,43	11,94*	15,07*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	9,25	10,80*	13,69*
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,33	9,87*	12,71*
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	10,89	12,37*	15,50*
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,53	10,03*	12,82*
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,89	10,65*	11,25*
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,20	9,76*	12,63*
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	11,07	12,53*	15,67*
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	8,60	10,09*	12,86*
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	11,71	13,27*	16,61*
Action de capitalisation de Catégorie SR	USD	9,12	10,34*	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	11,57	13,00*	16,13*
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	11,07	12,54*	15,67*
Systematic China Environmental Tech Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	USD	16.103.248	–	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,70	–	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,71	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,66	–	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,72	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,73	–	–
Action de capitalisation de Catégorie Z	USD	9,72	–	–
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	9,72	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Systematic Global Equity High Income Fund				
Total de l'actif net	USD	5.008.709.927	4.369.623.100	3.257.105.292
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	USD	9,03	8,92	–
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en CHF	CHF	8,49	8,80	–
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	USD	4,84	4,76	5,85*
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	3,22	3,28	4,11*
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	8,26	8,50	10,67*
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	7,52	7,59	9,44*
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	CAD	7,58	7,64	9,45*
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	79,40	81,75	100,90*
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	NZD	7,61	7,65	9,50*
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	ZAR	93,58	93,44	114,74*
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	7,96	7,95	9,79*
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	EUR	9,91	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	75,42	76,31	94,53*
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	8,21	8,33	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	7,05	7,20	8,96*
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	17,76	16,30	18,64*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,08	9,58	11,18*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	104,72	97,33	111,94*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	13,98	13,04	15,00*
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	9,67	9,29	10,84*
Action de Catégorie C de distribution (Q) (G)	USD	4,83	4,75	5,84*
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	14,38	13,37	15,48*
Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	USD	9,15	8,96	–
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en CHF	CHF	8,61	8,83	–
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G)	USD	5,39	5,25	6,40*
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	8,44	8,61	10,71*
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	8,55	8,62	10,73*
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,77	8,73	10,75*
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	USD	10,20	10,00	–
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	8,37	8,41	–
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,11	10,46	12,10*
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	20,03	15,70	14,98*
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	9,88	9,41	10,88*
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	EUR	7,32	7,45	9,35*
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	15,98	14,75	16,95*
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,29	8,87	10,41*
Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	USD	9,19	8,97	–
Action de Catégorie I de distribution (M) (G)	USD	9,82	9,61	11,75*
Action de Catégorie I de distribution (Q) (G)	USD	10,16	9,87	12,00*
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	8,27	8,42	10,45*
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	8,37	8,42	10,46*
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	17,11	15,54	17,56*
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G)	USD	9,43	9,28	–
Action de capitalisation de Catégorie SR	USD	10,45	9,51	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	14,19	12,81	14,39*

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund⁽²⁾				
Total de l'actif net	USD	21.994.428	–	–
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,63	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,52	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	CNH	102,27	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	HKD	103,98	–	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	SGD	10,37	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,09	–	–
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	USD	10,21	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,18	–	–
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	10,86	–	–
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,15	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,20	–	–
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	10,88	–	–
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,28	–	–
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,23	–	–
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾				
Total de l'actif net	USD	255.284.764	222.047.023	281.072.765
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	136,86	122,91	148,10
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	14,00	12,90	15,84
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	101,59	92,38	112,72
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	153,28	136,63	163,40
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	123,29	111,28	134,76
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	GBP	9,96	8,99	10,81
United Kingdom Fund				
Total de l'actif net	GBP	212.801.706	269.647.969	452.131.595
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	98,11	93,31*	118,97
Action de capitalisation de Catégorie A	GBP	120,14	113,29*	143,29
Action de capitalisation de Catégorie C	GBP	88,74	84,72*	108,51
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	98,41	93,58*	119,41
Action de capitalisation de Catégorie D	GBP	135,23	126,56*	158,87
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	135,23	126,56*	158,87
Action de capitalisation de Catégorie E	GBP	106,37	100,80*	128,14
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	GBP	10,14	9,64*	12,31
Action de capitalisation de Catégorie I	GBP	14,33	13,38*	16,75
Action de capitalisation de Catégorie X	GBP	152,76	141,53*	175,90

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
US Basic Value Fund				
Total de l'actif net	USD	889.769.923	759.596.354	960.620.592
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	111,76	105,33	110,70
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	111,59	90,61	80,21
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	10,31	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	113,67	106,72	112,15
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	183,32	177,20	183,49
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	67,10	65,21	69,99
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	20,93	19,98	21,11
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	79,58	75,65	80,50
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	55,88	55,00	59,78
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	112,77	106,25	111,72
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	112,54	91,35	80,90
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	129,28	120,47	125,65
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	72,76	70,21	74,78
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	102,08	96,32	101,73
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	56,19	54,89	59,21
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	128,65	119,57	124,39
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	152,62	140,80	145,38
US Dollar Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	553.666.735	572.662.883	771.881.953
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	14,83	15,59	18,08
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	14,84	15,60	18,09
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	31,46	32,13	36,76
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	13,96	14,67	17,01
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	22,67	23,44	27,16
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	14,84	15,59	18,09
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	33,18	33,74	38,46
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,85	10,17	11,63
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	28,13	28,87	33,21
Action de distribution (Q) de Catégorie I	USD	8,86	9,29	10,76
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,74	10,91	12,41
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,07	9,49	10,96
Action de Catégorie X de distribution (Q)	USD	8,80	9,23	10,69
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	10,46	10,57	11,97

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
US Dollar High Yield Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	1.885.887.744	2.357.372.193	3.591.197.714
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	9,01	9,09	10,71
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	5,21	5,18	6,03
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	5,25	5,22	6,09
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	AUD	9,70	9,83	11,57
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CAD	CAD	8,82	8,84	10,34
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	EUR	7,66	7,84	9,31
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	GBP	8,32	8,39	9,85
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	NZD	9,68	9,70	11,34
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en SGD	SGD	8,55	8,62	10,07
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	AUD	7,60	7,67	9,17
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	ZAR	76,54	77,05	90,97
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	CNH	85,64	88,78	105,70
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	4,21	4,25	5,05
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	30,92	31,53	37,69
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	7,60	7,75	9,25
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	36,87	34,83	39,04
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	17,58	16,91	19,12
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	10,45	10,30	11,76
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	206,88	201,30	229,57
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	15,47	14,80	16,64
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	5,21	5,19	6,04
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	27,29	26,11	29,63
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,97	9,04	10,66
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	9,00	8,95	10,43
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en SGD	SGD	8,58	8,64	10,10
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	AUD	18,90	18,05	20,28
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	11,09	10,85	12,31
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	224,84	217,23	246,02
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	16,59	15,76	17,60
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	40,06	32,37	30,35
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	33,17	31,49	35,47
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,07	8,87	10,17
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	7,77	7,84	9,24
Action de Catégorie I de distribution (M)	USD	8,48	8,43	9,82
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	16,34	15,31	17,01
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,63	11,22	12,69
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	CHF	9,16	8,94	10,13
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	10,24	9,72	10,88
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,49	8,56	10,09
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	8,73	7,46	7,33
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,85	7,96	7,45
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	9,37	9,05	10,24
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	USD	9,57	9,49	11,12
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	45,56	42,43	46,89
US Dollar Reserve Fund				
Total de l'actif net	USD	514.580.176	505.636.900	513.108.285
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	165,25	158,74	158,24
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	GBP	194,73	188,71	188,57
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	164,50	158,01	157,52
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	GBP	196,81	190,33	190,06
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	156,36	150,57	150,48
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en GBP	GBP	183,68	178,44	178,75
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	11,28	10,78	10,72

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
US Dollar Short Duration Bond Fund				
Total de l'actif net	USD	1.618.122.578	1.582.256.819	1.799.880.962
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	7,95	8,07	8,64
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	USD	9,95	–	–
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	7,95	8,07	8,64
Action de distribution (M) de Catégorie A couverte en CNH	CNH	99,73	–	–
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en SGD	SGD	8,81	9,04	9,69
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	13,70	13,48	14,26
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,31	9,40	10,09
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	10,18	10,01	10,59
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	7,93	8,05	8,62
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	10,56	10,52	11,27
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	9,12	9,26	9,92
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	14,23	13,94	14,70
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,38	9,44	10,09
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	12,26	12,11	12,88
Action de distribution (Q) de Catégorie I	USD	9,55	9,66	10,32
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	10,87	10,64	11,21
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	9,45	9,50	10,15
Action de distribution (M) de Catégorie S	USD	9,98	–	–
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	10,07	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,04	–	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	15,85	15,46	16,21
US Flexible Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	1.881.747.751	1.544.907.233	1.498.854.088
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	56,94	50,73	55,38
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	EUR	33,58	30,95	34,54
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	56,89	43,66	40,14
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	56,92	50,71	55,36
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	250,06	229,59	247,41
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CZK	CZK	98,85	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	33,48	30,86	34,44
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	JPY	1.484	1.399	1.545
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	17,75	15,82	17,27
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	43,60	39,33	43,48
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	24,27	22,65	25,60
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	60,59	53,57	58,04
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	60,53	46,11	42,08
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	64,94	57,42	62,22
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	38,17	34,92	38,67
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	51,47	46,09	50,56
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	29,20	27,05	30,33
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	39,06	34,45	37,23
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	15,26	13,92	15,38
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	76,31	66,80	71,65
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	16,01	14,50	15,90
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	GBP	9,97	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
US Government Mortgage Impact Fund				
Total de l'actif net	USD	87.175.682	101.674.992	139.597.939
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (D) de Catégorie A	USD	7,45	7,95	9,16
Action de distribution (M) de Catégorie A	USD	7,45	7,95	9,16
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	17,86	18,57	20,84
Action de distribution (D) de Catégorie C	USD	7,86	8,39	9,66
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	13,95	14,68	16,68
Action de distribution (M) de Catégorie D	USD	7,46	7,97	9,18
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	18,76	19,43	21,73
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	15,99	16,70	18,84
Action de Catégorie I de distribution (M)	USD	7,60	8,12	9,35
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,38	9,70	10,83
Action de Catégorie X de distribution (M)	USD	7,59	8,11	9,34
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	10,47	–	–
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,22	–	–
US Growth Fund				
Total de l'actif net	USD	392.063.710	310.964.654	602.871.140
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	43,32	35,80	52,41*
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	34,62	28,60	41,87*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	27,27	23,35	35,19*
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	34,62	24,64	30,38*
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	16,70	13,80	20,19*
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	26,02	21,77	32,27*
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	43,86	35,97	52,27*
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	38,93	31,92	46,39*
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	38,93	27,50	33,66*
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	31,20	25,91	38,12*
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	24,51	20,05	29,06*
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	10,55	8,56	12,32*
US Mid-Cap Value Fund				
Total de l'actif net	USD	243.390.151	264.640.243	328.740.239
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	328,16	308,83	320,21*
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	17,64	17,04	17,99*
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	241,55	230,18	241,66*
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	369,04	344,71	354,73*
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	290,50	274,76	286,31*
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	18,99	17,69	18,16*
US Sustainable Equity Fund				
Total de l'actif net	USD	4.817.353	4.276.723	5.429.548
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	9,06	8,32	10,79
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	9,22	8,41	10,81
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,23	7,24	7,84
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	9,97	9,20	11,99
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	9,28	8,43	10,81
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,28	7,26	7,85
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,42	7,32	7,86
Action de capitalisation de Catégorie ZI	USD	10,79	–	–

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

* Ajustement pour dilution compris, voir point 2(g) de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
World Energy Fund				
Total de l'actif net	USD	2.990.084.071	3.014.573.608	2.108.830.946
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	21,89	19,86	13,01
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	21,82	17,05	9,41
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	10,48	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	24,37	21,79	14,09
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	8,86	8,13	5,36
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	6,49	6,05	3,97
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,08	5,64	3,70
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	11,19	10,11	6,57
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	6,62	5,99	3,89
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	15,94	14,25	9,21
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	18,42	16,68	10,92
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	4,99	4,69	3,12
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	21,93	19,89	13,02
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	22,01	17,19	9,48
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	27,80	24,66	15,83
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	7,04	6,51	4,24
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	6,82	6,28	4,09
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	21,79	19,58	12,73
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	5,62	5,23	3,45
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	10,93	–	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	27,93	24,72	15,83
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,02	6,45	4,19
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	15,09	13,36	8,56
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	14,07	12,92	8,40
Action de Catégorie X de distribution (T)	USD	10,29	9,69	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	35,08	30,74	19,48
World Financials Fund				
Total de l'actif net	USD	1.791.609.535	1.419.083.947	1.633.640.408
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	11,14	9,17	12,57
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	11,81	–	–
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	125,23	102,85	140,98
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	13,53	11,17	15,38
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	37,45	26,20	30,04
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	15,15	12,31	16,75
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	28,68	23,58	32,51
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	42,23	29,32	33,37
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	33,72	27,51	37,65
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	14,79	11,90	16,03
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	10,60	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,54	–	–
Action de Catégorie X de distribution (T)	USD	11,34	9,71	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	21,62	17,25	23,08

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
World Gold Fund				
Total de l'actif net	USD	3.981.256.710	3.351.047.354	5.287.967.838
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	33,13	26,65	38,37
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	33,13	22,96	27,84
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	12,16	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	33,15	26,65	38,37
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,12	7,61	11,34
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	4,58	3,87	5,73
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	4,48	3,76	5,56
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	6,29	5,12	7,41
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	94,42	75,31	107,72
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	5,45	4,47	6,51
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	33,14	22,96	27,84
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	13,64	10,97	15,80
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	11,72	9,84	14,57
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	24,44	19,90	29,02
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	3,67	3,12	4,67
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	35,08	28,19	40,61
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	37,80	30,17	43,12
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	5,01	4,20	6,18
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	5,04	4,21	6,18
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	5,91	4,82	6,96
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	19,25	15,87	23,14
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	29,34	23,71	34,31
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	4,13	3,49	5,19
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	38,02	30,27	43,15
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	5,16	4,29	6,29
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	11,82	9,41	13,41
Action de Catégorie X de distribution (T)	USD	8,87	7,38	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	47,03	37,07	52,32
World Healthscience Fund				
Total de l'actif net	USD	13.611.805.574	13.872.428.365	14.078.116.205
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	12,22	11,18	12,52
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	10,11	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	64,74	59,27	66,33
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	21,09	19,74	22,37
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	184,92	174,33	192,47
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	218,82	202,83	228,25
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	JPY	1.305	1.262	1.428
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	21,67	20,15	22,64
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	14,06	13,30	15,16
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	17,24	15,78	17,66
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	49,35	45,75	51,84
Action de distribution (A) de Catégorie D	USD	16,57	15,09	16,79
Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	16,90	13,26	12,42
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	72,96	66,30	73,63
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,18	11,43	12,93
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	57,96	53,33	59,97
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,33	9,82	11,25
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	11,33	8,89	8,33
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	15,07	13,66	15,14
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,27	11,50	12,98
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	10,21	–	–
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	10,17	–	–
Action de Catégorie X de distribution (T)	USD	10,20	9,76	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	82,52	74,25	81,66

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
World Mining Fund				
Total de l'actif net	USD	5.409.681.596	5.369.730.517	7.065.270.881
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	54,64	49,53	58,15
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	53,15	41,51	41,05
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	10,35	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	60,94	54,43	61,88
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	11,09	10,27	12,05
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	CHF	7,41	6,93	8,08
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	EUR	4,53	4,20	4,90
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	HKD	10,48	9,48	10,83
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	PLN	8,89	7,88	9,01
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	5,31	4,84	5,57
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	18,14	16,21	18,42
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	EUR	13,59	12,61	14,71
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	45,10	40,79	46,96
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	EUR	3,71	3,49	4,12
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	53,28	41,62	41,21
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	69,52	61,63	69,54
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	8,05	7,47	8,66
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	5,07	4,67	5,41
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	PLN	9,64	8,48	9,63
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	SGD	8,36	7,57	8,64
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	34,82	31,75	36,78
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	54,09	48,55	55,47
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	4,18	3,90	4,57
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	12,85	–	–
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	69,74	61,66	69,40
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	5,27	4,84	5,60
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	69,75	–	–
Action de capitalisation de Catégorie S	USD	15,69	13,88	15,63
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	EUR	14,19	13,04	15,08
Action de Catégorie X de distribution (T)	USD	9,13	8,46	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	87,54	76,64	85,39
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	EUR	5,93	5,39	6,16
World Real Estate Securities Fund				
Total de l'actif net	USD	197.893.768	146.252.232	193.710.557
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	CNH	90,08	102,70	133,42
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	USD	9,05	10,04	12,96
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	HKD	94,20	105,19	136,27
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	SGD	9,31	10,48	13,60
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	10,14	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	14,17	15,16	19,05
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	USD	9,31	–	–
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	11,87	12,60	15,72
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	CHF	9,46	10,55	13,47
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	11,28	12,14	15,32
Action de Catégorie X de distribution (Q)	USD	6,79	–	–
Action de Catégorie X de distribution (T)	USD	8,33	9,25	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	13,09	13,76	16,99
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,91	10,72	13,46

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Récapitulatif des valeurs nettes d'inventaire sur trois ans

au 31 août 2023 suite

	Devise	31 août 2023	31 août 2022	31 août 2021
World Technology Fund				
Total de l'actif net	USD	9.798.788.652	8.792.222.507	13.553.638.267
Valeur Nette d'Inventaire par:				
Action de distribution (A) de Catégorie A	USD	9,30	8,02	12,34
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	9,29	6,91	8,95
Action de Catégorie A de distribution (T)	USD	12,29	–	–
Action de capitalisation de Catégorie A	USD	65,53	56,51	86,92
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	AUD	9,18	8,13	12,81
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	CNH	95,88	85,46	130,12
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	JPY	1.704	1.560	2.436
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	SGD	17,41	15,28	23,79
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	EUR	17,20	15,36	24,36
Action de capitalisation de Catégorie AI	USD	19,91	17,17	26,41
Action de capitalisation de Catégorie C	USD	49,70	43,40	67,60
Action de capitalisation de Catégorie D	USD	73,04	62,53	95,45
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	EUR	12,97	11,49	18,09
Action de capitalisation de Catégorie E	USD	59,18	51,29	79,29
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	EUR	7,81	7,01	11,17
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	7,93	5,83	7,48
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	GBP	8,57	7,50	11,63
Action de capitalisation de Catégorie I	USD	27,03	23,08	35,15
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	USD	11,38	8,67	12,31
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	EUR	18,39	16,26	25,53
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	USD	27,03	19,88	25,50
Action de Catégorie X de distribution (T)	USD	10,95	9,95	–
Action de capitalisation de Catégorie X	USD	25,68	21,76	32,90

Les prix sont libellés dans la ou les Devises de Négociation de la Catégorie d'Actions concernée. Dans le cas des Catégories d'Actions pour lesquelles il existe deux Devises de Négociation disponibles, ou plus, la Devise de Référence de la Catégorie d'Actions concernée est présentée. Les cours des devises de négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation. Pour les actions non couvertes de fonds déclarants au Royaume-Uni, les prix comparatifs sont exprimés en GBP. Les prix actuels de fin d'exercice sont exprimés dans la devise de base du Compartiment concerné.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023

Nom du Compartiment	Note	BlackRock	Asia Pacific	Asian
		Global Funds Combinés USD	Equity Income Fund ⁽¹⁾ USD	Dragon Fund USD
Actif net au début de l'exercice		158.705.943.828	116.844.096	865.199.577
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	163.957.031	2.774	1.437.742
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	2.468.351.055	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	368.235.899	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	6.141.355	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	135.127.404	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	34.197.703	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	87.936.108	28.672	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	1.784.580.146	1.171.068	18.262.846
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	3.035.901	-	23.285
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	36.048.842	5.253	31.600
Remise sur la commission de gestion	4	3.900.709	-	-
Autres remboursements	10	474.618	-	-
Total des revenus	2(b)	5.091.986.771	1.207.767	19.755.473
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	97.479	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	1.721.760	-	49.107
Intérêts sur swaps	2(c)	424.777.854	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	4.555.740	-	590
Frais de gestion annuels	6	261.450.777	148.143	1.893.766
Commissions d'engagement de prêt	16	475.133	-	2.538
Commissions du Dépositaire	2(h),7	31.438.413	52.647	310.819
Commissions de distribution	5	123.010.269	30.579	842.087
Impôt	8	61.819.724	14.714	359.950
Commissions de gestion	4	1.659.317.758	781.463	8.981.175
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	(25.741)	-	-
Frais totaux		2.568.639.166	1.027.546	12.440.032
Revenu/(déficit) net		2.523.347.605	180.221	7.315.441
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(5.280.203.236)	3.482.150	(34.108.863)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	(1.327.754)	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	(41.878.653)	-	1.090.030
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	60.024.011	-	269.563
Contrats d'options/swaptions	2(c)	212.942.943	-	-
Opérations de swap	2(c)	(364.203.972)	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	(163.407.802)	191.198	1.426.188
Autres opérations de change	2(i)	16.998.368	(136.202)	(4.967)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(5.561.056.095)	3.537.146	(31.328.049)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	13.300.108.742	(902.134)	26.708.807
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	(20.306.038)	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	13.307.818	-	269.563
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	4.280.905	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	1.410.688	-	-
Opérations de swap	2(c)	58.554.972	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	172.400.123	787.258	1.353.570
Autres opérations de change	2(i)	766.169	27.166	39.164
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		13.530.523.379	(87.710)	28.371.104
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		10.492.814.889	3.629.657	4.358.496
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		46.437.918.029	5.128.477	178.882.030
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(61.371.151.406)	(124.517.398)	(264.611.724)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(14.933.233.377)	(119.388.921)	(85.729.694)
Dividendes déclarés	15	(1.443.988.479)	(1.084.832)	(231.664)
Ajustement de change	2(e)	2.432.084.033*	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		155.253.620.894	-	783.596.715

⁽¹⁾ Compartiment dissous au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

* Les chiffres combinés ont été calculés à l'aide des taux de change moyens tout au long de l'exercice. L'ajustement des taux de change obtenu, de 2.432.084.033 USD, représente la variation des taux de change entre le 31 août 2022 et le 31 août 2023. Il s'agit d'un montant notionnel, qui n'a aucun impact sur l'actif net de chacun des Compartiments.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Asian Growth Leaders Fund	Asian High Yield Bond Fund	Asian Multi-Asset Income Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		838.847.579	2.117.939.025	73.282.472
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	976.914	4.915.911	154.236
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	188.860.295	1.665.741
Intérêts sur swaps	2(c)	–	306.576	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	1.445.257	155.989
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	12.406.619	–	956.146
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	19.298	3.294.845	6.443
Remise sur la commission de gestion	4	–	49.376	–
Autres remboursements	10	–	27.076	237
Total des revenus	2(b)	13.402.831	198.899.336	2.938.792
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	3.266.281	1.306
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	1.584.370	2.134.948	(160.068)
Commissions d'engagement de prêt	16	2.505	6.574	213
Commissions du Dépositaire	2(h),7	249.671	253.101	185.716
Commissions de distribution	5	126.008	155.955	–
Impôt	8	304.573	691.662	6.611
Commissions de gestion	4	7.260.115	14.997.609	5.250
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		9.527.242	21.506.130	39.028
Revenu/(déficit) net		3.875.589	177.393.206	2.899.764
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(98.747.306)	(693.890.400)	(8.627.966)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	850.068	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	346.811	(5.591.338)	(73.577)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	(3.843.352)	1.866.864
Opérations de swap	2(c)	–	639.587	(69.421)
Contrats de change à terme	2(c)	773.815	6.916.215	(33.626)
Autres opérations de change	2(i)	(162.044)	987.191	(10.556)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(96.938.656)	(694.782.097)	(6.948.282)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	83.778.266	429.033.451	4.421.292
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	346.811	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	1.463.809	45.993
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	(2.115.271)	167.709
Opérations de swap	2(c)	–	(2.340.351)	8.684
Contrats de change à terme	2(c)	1.174.580	6.451.536	(29.206)
Autres opérations de change	2(i)	6.188	232.023	(1.248)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		85.305.845	432.725.197	4.613.224
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(7.757.222)	(84.663.694)	564.706
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		103.158.350	715.390.147	332.095
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(343.491.831)	(1.164.978.388)	(4.578.297)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(240.333.481)	(449.588.241)	(4.246.202)
Dividendes déclarés	15	(267.787)	(68.779.503)	(9.050)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		590.489.089	1.514.907.587	69.591.926

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Asian Sustainable Equity Fund	Asian Tiger Bond Fund	Brown To Green Materials Fund ⁽²⁾
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		4.576.810	3.526.988.067	-
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	14.486	5.670.003	7.197
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	157.701.105	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	489.866	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	2.534.505	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	127.761	-	23.760
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	2.536	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	1.089	2.596.029	-
Remise sur la commission de gestion	4	-	108.963	-
Autres remboursements	10	-	87.146	43
Total des revenus	2(b)	145.872	169.187.617	31.000
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	3.660.983	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	(7.423)	3.888.044	(221)
Commissions d'engagement de prêt	16	14	10.798	-
Commissions du Dépositaire	2(h),7	17.855	377.193	4.379
Commissions de distribution	5	22	334.534	6
Impôt	8	1.721	1.263.738	895
Commissions de gestion	4	13.148	26.086.489	193
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		25.337	35.621.779	5.252
Revenu/(déficit) net		120.535	133.565.838	25.748
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(108.379)	(455.669.194)	50.725
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	11.740	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(5.301)	(9.983.028)	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	(5.775.999)	-
Opérations de swap	2(c)	-	(4.507.688)	-
Contrats de change à terme	2(c)	-	10.716.364	-
Autres opérations de change	2(i)	(6.068)	(1.078.559)	(17.566)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(108.008)	(466.298.104)	33.159
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	(48.159)	295.492.364	297.262
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	614	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	42.471	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	(1.099.616)	-
Opérations de swap	2(c)	-	(1.320.742)	-
Contrats de change à terme	2(c)	-	19.542.803	-
Autres opérations de change	2(i)	59	762.896	2
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		(47.486)	313.420.176	297.264
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(34.959)	(19.312.090)	356.171
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		3.853.390	584.491.741	20.067.121
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(1)	(1.206.531.471)	(90)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		3.853.389	(622.039.730)	20.067.031
Dividendes déclarés	15	-	(91.625.870)	-
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		8.395.240	2.794.010.377	20.423.202

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	China Bond Fund	China Flexible Equity Fund	China Fund
		CNH	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		38.725.399.779	22.576.970	1.153.645.347
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	45.606.202	69.403	825.229
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	1.420.400.350	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	1.245.442	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	6.632.303	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	22.394.288	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	309.628	20.394.787
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	132.616
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	13.275.641	471	97.678
Remise sur la commission de gestion	4	1.077.860	-	24.144
Autres remboursements	10	249.322	-	339
Total des revenus	2(b)	1.510.881.408	379.502	21.474.793
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	2.416	-
Intérêts sur swaps	2(c)	679.825	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	40.938.177	28.804	2.512.694
Commissions d'engagement de prêt	16	122.773	70	3.495
Commissions du Dépositaire	2(h),7	18.159.266	25.462	306.246
Commissions de distribution	5	34.919.996	46.338	283.437
Impôt	8	13.366.926	6.235	494.516
Commissions de gestion	4	206.502.123	148.806	13.930.896
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		314.689.086	258.131	17.531.284
Revenu/(déficit) net		1.196.192.322	121.371	3.943.509
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(1.593.118.704)	(3.056.502)	(226.404.936)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	(4.808)	(30.828.098)
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	4.005.058	(3.661)	9.226.114
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(34.415.903)	-	-
Opérations de swap	2(c)	(10.724.492)	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	(284.019.343)	177.234	(5.153.139)
Autres opérations de change	2(i)	54.324.956	(345)	(424.151)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(1.863.948.428)	(2.888.082)	(253.584.210)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	1.368.835.698	122.553	49.520.390
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	(3.661)	9.226.114
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	4.585.754	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(17.277.327)	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	142.583.937	35.008	2.985.418
Autres opérations de change	2(i)	(2.113.879)	14	157
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		1.496.614.183	153.914	61.732.079
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		828.858.077	(2.612.797)	(187.908.622)
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		2.701.753.222	3.313.444	472.830.004
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(15.117.424.235)	(1.406.779)	(418.187.058)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(12.415.671.013)	1.906.665	54.642.946
Dividendes déclarés	15	(885.128.983)	-	(46.969)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		26.253.457.860	21.870.838	1.020.332.702

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	China Impact Fund	China Innovation Fund	China Multi-Asset Fund ⁽²⁾
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		30.463.840	20.651.662	-
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	70.706	16.028	6.643
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	754
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	333.388	218.181	29.155
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	-	2.220	-
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	-	-	-
Total des revenus	2(b)	404.094	236.429	36.552
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	42.743	(11.635)	(2.825)
Commissions d'engagement de prêt	16	77	-	-
Commissions du Dépositaire	2(h),7	34.017	23.666	5.216
Commissions de distribution	5	15.411	83	-
Impôt	8	9.230	2.095	332
Commissions de gestion	4	249.826	2.942	45
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		351.304	17.151	2.768
Revenu/(déficit) net		52.790	219.278	33.784
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(5.500.010)	(2.388.050)	44.398
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	-	15.012
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	(49.848)
Contrats de change à terme	2(c)	72.232	(1.700)	(62)
Autres opérations de change	2(i)	(4.215)	(5.097)	995
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(5.431.993)	(2.394.847)	10.495
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	(1.305.355)	1.988.256	(666.504)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	-	79.736
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	49.848
Contrats de change à terme	2(c)	31.975	(248)	(61)
Autres opérations de change	2(i)	(31)	2.508	-
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		(1.273.411)	1.990.516	(536.981)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(6.652.614)	(185.053)	(492.702)
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		4.529.555	587.146	20.000.079
Paievements nets résultant du rachat d'actions		(2.538.101)	(271.499)	-
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		1.991.454	315.647	20.000.079
Dividendes déclarés	15	-	-	(76)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		25.802.680	20.782.256	19.507.301

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	China Onshore Bond Fund ⁽²⁾	Circular Economy Fund	Climate Action Equity Fund
		CNH	USD	USD
Actif net au début de l'exercice			1.796.330.423	4.083.788
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	388.185	3.446.089	10.920
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	16.709.874	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	231.792	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	26.164.126	60.650
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	1.962	202.849	289
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	2.538	12.580	1
Total des revenus	2(b)	17.334.351	29.825.644	71.860
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	187.451	1.784.855	(13.421)
Commissions d'engagement de prêt	16	-	5.243	12
Commissions du Dépositaire	2(h),7	396.462	218.960	16.984
Commissions de distribution	5	171	1.772.713	549
Impôt	8	75.520	418.340	523
Commissions de gestion	4	82.292	16.040.981	2.278
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		741.896	20.241.092	6.925
Revenu/(déficit) net		16.592.455	9.584.552	64.935
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	931.024	(27.925.269)	(95.126)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	1.452.877	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(3.412)	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	29.223.707	(38.886.471)	-
Autres opérations de change	2(i)	1.592.597	(580.269)	(982)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		33.196.793	(67.392.009)	(96.108)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	3.025.621	209.334.555	262.101
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	192.788	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(402.664)	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	3.220.390	6.418.557	-
Autres opérations de change	2(i)	12.654	124.274	95
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		6.048.789	215.877.386	262.196
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		55.838.037	158.069.929	231.023
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		884.507.455	224.372.432	318.306
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(179.877.323)	(515.450.297)	(67.201)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		704.630.132	(291.077.865)	251.105
Dividendes déclarés	15	(348.817)	(80.795)	-
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		760.119.352	1.663.241.692	4.565.916

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Climate Action Multi-Asset Fund EUR	Continental European Flexible Fund EUR	Developed Markets Sustainable Equity Fund USD
Actif net au début de l'exercice		47.930.052	5.070.548.567	10.787.561
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	50.200	–	20.609
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	200.844	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	236.499	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	577.555	100.109.185	219.373
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	501.273	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	2.565	609.198	410
Remise sur la commission de gestion	4	5.006	–	–
Autres remboursements	10	111	30.722	10
Total des revenus	2(b)	1.072.780	101.250.378	240.402
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	12.301	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	207.141	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	13.993	9.604.568	(5.417)
Commissions d'engagement de prêt	16	133	14.296	24
Commissions du Dépositaire	2(h),7	129.124	801.954	13.138
Commissions de distribution	5	501	2.577.379	21
Impôt	8	4.521	1.941.797	1.895
Commissions de gestion	4	1.612	50.209.976	42.102
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		149.884	65.369.412	51.763
Revenu/(déficit) net		922.896	35.880.966	188.639
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(2.675.659)	46.176.950	(233.883)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	1.060.286	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(553.487)	4.955.599	(594)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(129.525)	–	–
Opérations de swap	2(c)	(39.530)	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	496	(26.327.073)	(86.656)
Autres opérations de change	2(i)	(53.825)	(66.709)	(1.145)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(3.451.530)	25.799.053	(322.278)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	252.012	762.421.078	2.018.064
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	(1.078.310)	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(109.224)	(6.605)	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	50.742	–	–
Opérations de swap	2(c)	11.730	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	(311.447)	1.800.779	(2.022)
Autres opérations de change	2(i)	(304)	(13.058)	311
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		(106.491)	763.123.884	2.016.353
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(2.635.125)	824.803.903	1.882.714
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		257.518	1.378.460.726	10.353.243
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(11.744)	(1.943.396.503)	(5.719.055)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		245.774	(564.935.777)	4.634.188
Dividendes déclarés	15	(177)	(9.216.487)	–
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		45.540.524	5.321.200.206	17.304.463

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Dynamic High Income Fund	Emerging Europe Fund ⁽³⁾	Emerging Markets Bond Fund
		USD	EUR	USD
Actif net au début de l'exercice		3.119.186.697	161.213.607	912.526.191
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	7.553.600	100.810	2.002.434
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	89.619.172	–	54.667.305
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	38.207
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	68.590.713	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	8.912.482	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	18.682.105	8.344.446	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	58.489	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	659.884	66.474	245.229
Remise sur la commission de gestion	4	825.778	–	–
Autres remboursements	10	50.549	2.941	6.616
Total des revenus	2(b)	194.952.772	8.514.671	56.959.791
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	5.045	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	2.299.389
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	5.749.971	6.093	948.501
Commissions d'engagement de prêt	16	9.189	896	2.743
Commissions du Dépositaire	2(h),7	579.806	711.478	169.945
Commissions de distribution	5	59.818	–	480.975
Impôt	8	1.398.418	101.242	279.612
Commissions de gestion	4	42.480.754	–	7.415.771
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		50.283.001	819.709	11.596.936
Revenu/(déficit) net		144.669.771	7.694.962	45.362.855
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(169.855.699)	4.065.581	(88.026.717)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	286.866	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(18.641.473)	7.295.018	16.414.992
Contrats d'options/swaptions	2(c)	4.057.819	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	3.480.358
Contrats de change à terme	2(c)	(6.848.968)	(9.940)	8.456.433
Autres opérations de change	2(i)	761.858	1.367.874	(27.950)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(190.239.597)	12.718.533	(59.702.884)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	157.040.171	86.897.429	105.917.746
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	179.922	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	4.534.969	(156.422)	73.554
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(456.030)	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	(4.424.119)
Contrats de change à terme	2(c)	14.312.417	2.709	1.471.163
Autres opérations de change	2(i)	(196.497)	(2.537.781)	36.120
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		175.414.952	84.205.935	103.074.464
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		129.845.126	104.619.430	88.734.435
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		582.132.381	–	320.870.810
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(797.541.156)	–	(328.962.097)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(215.408.775)	–	(8.091.287)
Dividendes déclarés	15	(201.868.689)	–	(10.290.807)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		2.831.754.359	265.833.037	982.878.532

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Emerging Markets Corporate Bond Fund	Emerging Markets Equity Income Fund	Emerging Markets Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		808.537.589	314.381.909	2.246.518.528
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	1.149.366	250.404	5.240.040
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	46.544.863	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	6.593.044	50.984.926
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	108.701	1.099.953
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	729.587	32.002	264.525
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	9.419	958	3.744
Total des revenus	2(b)	48.433.235	6.985.109	57.593.188
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	80.460	1.200.903
Intérêts sur swaps	2(c)	269.170	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	1.182	-
Frais de gestion annuels	6	339.460	412.786	2.345.933
Commissions d'engagement de prêt	16	2.434	876	6.609
Commissions du Dépositaire	2(h),7	118.411	183.610	1.673.435
Commissions de distribution	5	115.345	42.629	644.938
Impôt	8	140.385	80.435	527.600
Commissions de gestion	4	3.674.093	1.591.522	18.051.497
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		4.659.298	2.393.500	24.450.915
Revenu/(déficit) net		43.773.937	4.591.609	33.142.273
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(69.235.828)	(17.628.239)	(210.080.410)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	1.068.130	3.046.751
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(1.134.026)	1.034.624	997.267
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	648.052	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	(4.355.913)	564.337	(2.572.657)
Autres opérations de change	2(i)	(236.627)	(34.973)	1.199.782
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(74.314.342)	(14.996.121)	(207.409.267)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	53.107.961	31.940.915	265.581.313
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	1.106.976	3.426.633
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	232.414	19.025	(1.449.309)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	(440.448)	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	3.026.070	(72.495)	4.082
Autres opérations de change	2(i)	11.866	(415.003)	(3.606.083)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		55.937.863	32.579.418	263.956.636
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		25.397.458	22.174.906	89.689.642
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		110.353.553	45.178.458	904.438.826
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(157.602.320)	(175.086.206)	(734.149.154)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(47.248.767)	(129.907.748)	170.289.672
Dividendes déclarés	15	(6.790.358)	(1.373.221)	(3.033.772)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		779.895.922	205.275.846	2.503.464.070

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Emerging Markets Impact Bond Fund	Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Emerging Markets Sustainable Equity Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		84.171.455	1.417.858.380	53.883.168
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	245.794	1.263.786	75.439
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	3.612.605	108.720.090	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	2.005.219	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	1.138.333
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	117
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	44.176	160.091	4.791
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	6	(320.666)	-
Total des revenus	2(b)	3.902.581	111.828.520	1.218.680
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	3.938
Intérêts sur swaps	2(c)	-	1.919.792	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	27.089	983.385	8.212
Commissions d'engagement de prêt	16	244	4.384	159
Commissions du Dépositaire	2(h),7	20.288	1.087.746	37.964
Commissions de distribution	5	21	149.544	175
Impôt	8	8.974	353.381	6.038
Commissions de gestion	4	284.496	8.237.483	13.566
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		341.112	12.735.715	70.052
Revenu/(déficit) net		3.561.469	99.092.805	1.148.628
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(5.125.317)	(126.256.634)	(2.630.128)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	27.440
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	(1.899.166)	(177.948)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	(1.015.052)	-
Opérations de swap	2(c)	-	(21.459)	-
Contrats de change à terme	2(c)	2.561.893	3.504.766	45.125
Autres opérations de change	2(i)	38.784	1.045.319	(31.259)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(2.524.640)	(124.642.226)	(2.766.770)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	5.008.014	218.100.819	4.689.312
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	(51.785)
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	447.778	10.605
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	509.023	-
Opérations de swap	2(c)	-	1.983.287	-
Contrats de change à terme	2(c)	424.349	2.836.342	(36.316)
Autres opérations de change	2(i)	2.969	730.609	(155.109)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		5.435.332	224.607.858	4.456.707
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		6.472.161	199.058.437	2.838.565
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		17.761.433	753.765.792	28.026.609
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(16.117.306)	(736.541.937)	(7.232.516)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		1.644.127	17.223.855	20.794.093
Dividendes déclarés	15	(26.330)	(6.260.897)	-
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		92.261.413	1.627.879.775	77.515.826

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	ESG Flex	ESG Flex	ESG Flex
		Choice Cautious Fund USD	Choice Growth Fund USD	Choice Moderate Fund USD
Actif net au début de l'exercice		11.971.283	14.275.652	13.979.090
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	637	553	674
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	294.945	173.958	230.440
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	34	267	163
Remise sur la commission de gestion	4	18.627	23.411	20.886
Autres remboursements	10	825	484	339
Total des revenus	2(b)	315.068	198.673	252.502
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	(14.205)	(4.372)	2.653
Commissions d'engagement de prêt	16	29	40	41
Commissions du Dépositaire	2(h),7	46.094	41.725	29.339
Commissions de distribution	5	-	-	-
Impôt	8	3.926	4.812	4.580
Commissions de gestion	4	64.022	74.055	69.220
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		99.866	116.260	105.833
Revenu/(déficit) net		215.202	82.413	146.669
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(291.809)	(128.883)	(193.541)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	(37.983)	(202.622)	(128.216)
Autres opérations de change	2(i)	216	(11.543)	(189)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(329.576)	(343.048)	(321.946)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	258.218	1.038.141	681.267
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	6.383	67.398	44.200
Autres opérations de change	2(i)	(3)	246	12
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		264.598	1.105.785	725.479
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		150.224	845.150	550.202
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		22.632.768	3.757.415	8.407.000
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(24.845.082)	(6.093.506)	(9.410.103)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(2.212.314)	(2.336.091)	(1.003.103)
Dividendes déclarés	15	(76.646)	(378.766)	(274.232)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		9.832.547	12.405.945	13.251.957

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	ESG Global	ESG Global	ESG
		Conservative Income Fund EUR	Multi-Asset Income Fund USD	Multi-Asset Fund EUR
Actif net au début de l'exercice		644.684.234	158.055.424	6.719.550.491
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	527.928	382.016	9.610.224
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	15.245.676	4.776.135	51.598.824
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	435.694
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	3.131.845	1.686.269	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	782.712	439.518	26.690.985
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	1.358.614	949.962	52.869.014
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	96.365	2.593	666.429
Remise sur la commission de gestion	4	25.976	7.899	946.157
Autres remboursements	10	2.426	359	30.962
Total des revenus	2(b)	21.171.542	8.244.751	142.848.289
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	54	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	115.274
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	943.175	(54.057)	11.525.012
Commissions d'engagement de prêt	16	1.827	491	18.970
Commissions du Dépositaire	2(h),7	122.479	157.662	994.645
Commissions de distribution	5	1.460.608	87	20.603.274
Impôt	8	215.738	16.927	2.917.548
Commissions de gestion	4	4.702.529	43.644	70.802.046
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		7.446.356	164.808	106.976.769
Revenu/(déficit) net		13.725.186	8.079.943	35.871.520
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(29.398.914)	(7.622.314)	(120.033.667)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	1.993.427
« Contracts for difference »	2(c)	-	(1.133)	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(4.963.361)	(191.926)	(46.316.163)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	188.660	123.573	(23.759.031)
Opérations de swap	2(c)	-	-	(64.090.666)
Contrats de change à terme	2(c)	11.587.696	3.079.796	49.766.314
Autres opérations de change	2(i)	(1.349.517)	357.217	(10.940.597)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(23.935.436)	(4.254.787)	(213.380.383)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	(21.292.224)	5.724.988	(226.177.245)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	(538.625)
« Contracts for difference »	2(c)	-	(1.525)	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	13.822.241	(861.439)	4.158.012
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(48.679)	(22.421)	7.189.073
Opérations de swap	2(c)	-	-	4.263.232
Contrats de change à terme	2(c)	(100.642)	4.507.362	(29.687.299)
Autres opérations de change	2(i)	212.026	5.779	(1.245.113)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		(7.407.278)	9.352.744	(242.037.965)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(17.617.528)	13.177.900	(419.546.828)
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		46.598.615	7.780.609	1.979.875.345
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(290.476.077)	(6.063.817)	(2.209.848.888)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(243.877.462)	1.716.792	(229.973.543)
Dividendes déclarés	15	(15.970.388)	(5.912.553)	(10.715.727)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		367.218.856	167.037.563	6.059.314.393

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	ESG Systematic	Euro	Euro
		Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾ USD	Bond Fund EUR	Corporate Bond Fund EUR
Actif net au début de l'exercice		81.153.606	3.192.055.061	2.555.209.490
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	41.690	414.647	1.261.459
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	4.344.415	57.213.634	75.405.482
Intérêts sur swaps	2(c)	–	6.962.394	4.986.380
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	28.750	–	1.077.270
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	12.839	426.675	512.320
Remise sur la commission de gestion	4	6.427	8.406	53.593
Autres remboursements	10	(1.400)	13.181	29.118
Total des revenus	2(b)	4.432.721	65.038.937	83.325.622
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	8.111.975	14.019.501
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	(9.689)	2.004.467	1.880.438
Commissions d'engagement de prêt	16	210	9.016	7.234
Commissions du Dépositaire	2(h),7	50.990	573.494	372.787
Commissions de distribution	5	190	537.594	626.003
Impôt	8	8.216	615.437	636.028
Commissions de gestion	4	9.624	12.841.543	9.978.893
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		59.541	24.693.526	27.520.884
Revenu/(déficit) net		4.373.180	40.345.411	55.804.738
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(5.172.943)	(266.199.306)	(150.073.369)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(249.324)	4.614.930	12.140.897
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	(2.362.802)	5.817.873
Opérations de swap	2(c)	–	(26.082.519)	(65.658.211)
Contrats de change à terme	2(c)	(7.110.283)	(17.648.237)	(11.343.422)
Autres opérations de change	2(i)	242.850	(2.573.590)	1.260.120
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(12.289.700)	(310.251.524)	(207.856.112)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	5.555.832	183.656.682	182.389.089
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	17.508	514.252	(5.320.160)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	569.210	3.074.546
Opérations de swap	2(c)	–	13.704.319	17.817.792
Contrats de change à terme	2(c)	851.677	(10.292.811)	(129.663)
Autres opérations de change	2(i)	505	(258.730)	(6.054)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		6.425.522	187.892.922	197.825.550
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(1.490.998)	(82.013.191)	45.774.176
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		28.449.362	890.179.536	1.593.863.008
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(16.064.799)	(2.051.132.155)	(1.384.546.885)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		12.384.563	(1.160.952.619)	209.316.123
Dividendes déclarés	15	–	(1.022.125)	(6.852.105)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		92.047.171	1.948.067.126	2.803.447.684

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Euro Reserve Fund EUR	Euro Short Duration Bond Fund EUR	Euro-Markets Fund EUR
Actif net au début de l'exercice		121.337.594	5.402.466.533	1.301.315.661
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	30.403	1.056.430	28.192
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	878.897	83.065.478	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	10.317.596	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	1.843.054	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	284.665	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	672	25.662.073
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	-	887.817	67.808
Remise sur la commission de gestion	4	-	69.144	-
Autres remboursements	10	-	20.204	15.416
Total des revenus	2(b)	2.752.354	95.702.006	25.773.489
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	13.572.749	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	100.145	2.311.927	2.737.002
Commissions d'engagement de prêt	16	-	15.854	3.620
Commissions du Dépositaire	2(h),7	37.427	823.338	200.002
Commissions de distribution	5	77.565	1.090.080	588.372
Impôt	8	12.785	1.236.219	532.106
Commissions de gestion	4	554.917	19.851.724	15.089.965
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	(24.296)	-	-
Frais totaux		758.543	38.901.891	19.151.067
Revenu/(déficit) net		1.993.811	56.800.115	6.622.422
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	61.523	(135.947.156)	83.822.717
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	41.491.634	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	(3.984.291)	-
Opérations de swap	2(c)	-	(18.507.668)	-
Contrats de change à terme	2(c)	-	1.552.288	(1.814.770)
Autres opérations de change	2(i)	-	2.069.039	(126.682)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		61.523	(113.326.154)	81.881.265
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	121.043	115.436.406	95.435.139
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	(13.756.441)	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	1.019.171	-
Opérations de swap	2(c)	-	11.138.785	-
Contrats de change à terme	2(c)	-	(5.482.559)	(518.156)
Autres opérations de change	2(i)	-	(423.906)	1.859
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		121.043	107.931.456	94.918.842
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		2.176.377	51.405.417	183.422.529
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		126.902.957	1.943.904.922	343.882.939
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(114.113.246)	(2.657.457.159)	(548.952.191)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		12.789.711	(713.552.237)	(205.069.252)
Dividendes déclarés	15	-	(754.103)	(428.930)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		136.303.682	4.739.565.610	1.279.240.008

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	European Equity Income Fund	European Focus Fund	European Fund
		EUR	EUR	EUR
Actif net au début de l'exercice		1.788.035.472	326.098.002	1.220.902.141
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	37.217	6.990	28.084
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	68.866.039	6.249.232	23.662.052
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	390.439	33.850	138.032
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	29.275	3.997	22.150
Total des revenus	2(b)	69.322.970	6.294.069	23.850.318
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	3.860.985	842.045	2.192.087
Commissions d'engagement de prêt	16	5.037	904	3.380
Commissions du Dépositaire	2(h),7	273.043	77.925	192.209
Commissions de distribution	5	1.057.340	811.642	632.021
Impôt	8	732.874	161.731	452.207
Commissions de gestion	4	21.122.967	4.306.852	11.384.726
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		27.052.246	6.201.099	14.856.630
Revenu/(déficit) net		42.270.724	92.970	8.993.688
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	83.230.289	13.104.982	44.777.140
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	(22.541.270)	(248.415)	(4.874.565)
Autres opérations de change	2(i)	(242.648)	26.054	230.832
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		60.446.371	12.882.621	40.133.407
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	24.237.183	36.201.025	135.823.342
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	(3.909.131)	(61.786)	(1.061.563)
Autres opérations de change	2(i)	(55.393)	1.065	5.383
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		20.272.659	36.140.304	134.767.162
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		122.989.754	49.115.895	183.894.257
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		255.583.057	30.920.453	432.944.863
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(553.619.599)	(66.053.338)	(500.294.949)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(298.036.542)	(35.132.885)	(67.350.086)
Dividendes déclarés	15	(47.507.313)	-	(16.824)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		1.565.481.371	340.081.012	1.337.429.488

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	European High Yield Bond Fund	European Special Situations Fund	European Sustainable Equity Fund
		EUR	EUR	EUR
Actif net au début de l'exercice		301.180.428	1.127.016.712	4.831.817
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	96.501	22.519	154
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	16.524.663	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	585.696	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	22.621.487	79.961
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	381.578	169.660	608
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	3.943	19.829	58
Total des revenus	2(b)	17.592.381	22.833.495	80.781
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	70.450	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	440.018	2.507.673	(6.841)
Commissions d'engagement de prêt	16	926	3.100	13
Commissions du Dépositaire	2(h),7	56.077	196.706	10.295
Commissions de distribution	5	343.064	542.456	472
Impôt	8	142.791	493.310	684
Commissions de gestion	4	1.738.785	14.117.572	3.274
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		2.792.111	17.860.817	7.897
Revenu/(déficit) net		14.800.270	4.972.678	72.884
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(23.554.202)	15.502.401	(206.842)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	227.396	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(713.045)	-	-
Opérations de swap	2(c)	(3.881.714)	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	641.483	(7.200.204)	-
Autres opérations de change	2(i)	(739.338)	(3.060)	418
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(28.019.420)	8.299.137	(206.424)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	25.099.052	149.732.155	735.091
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(41.655)	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	177.555	-	-
Opérations de swap	2(c)	2.344.378	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	(587.317)	(1.462.585)	-
Autres opérations de change	2(i)	20.207	21.377	21
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		27.012.220	148.290.947	735.112
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		13.793.070	161.562.762	601.572
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		170.362.994	237.604.653	428.335
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(162.933.126)	(287.206.983)	(288.199)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		7.429.868	(49.602.330)	140.136
Dividendes déclarés	15	(1.670.900)	(3.089)	-
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		320.732.466	1.238.974.055	5.573.525

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	European Value Fund	FinTech Fund	Fixed Income Global Opportunities Fund
		EUR	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		773.465.607	415.642.180	8.997.090.506
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	15.545	617.998	20.874.791
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	333.722.271
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	270.285.382
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	10.020
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	5.372.523
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	113.466
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	26.899.300	2.531.493	4.074.224
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	131.869	44.812	1.763.685
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	2.622
Autres remboursements	10	24.615	1.699	17.576
Total des revenus	2(b)	27.071.329	3.196.002	636.236.560
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	315.080.895
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	4.645
Frais de gestion annuels	6	1.421.619	638.083	5.120.816
Commissions d'engagement de prêt	16	2.249	1.170	27.226
Commissions du Dépositaire	2(h),7	138.173	57.427	1.320.104
Commissions de distribution	5	622.707	488.312	2.415.202
Impôt	8	283.220	121.946	1.662.367
Commissions de gestion	4	7.895.698	3.424.409	29.603.139
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		10.363.666	4.731.347	355.234.394
Revenu/(déficit) net		16.707.663	(1.535.345)	281.002.166
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	32.107.157	(130.499.270)	(571.144.910)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	21.161.236
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	(158.833)
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	143.870.732
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	18.474.648
Opérations de swap	2(c)	–	–	6.890.679
Contrats de change à terme	2(c)	(2.748.572)	1.092.552	(78.707.383)
Autres opérations de change	2(i)	251.677	(50.256)	(9.915.572)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		29.610.262	(129.456.974)	(469.529.403)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	70.980.679	108.386.685	370.946.736
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	(21.228.168)
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	356.476
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	(34.502.408)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	6.151.932
Opérations de swap	2(c)	–	–	(42.391.859)
Contrats de change à terme	2(c)	(626.421)	1.052.361	20.723.954
Autres opérations de change	2(i)	27.818	(618)	5.033.581
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		70.382.076	109.438.428	305.090.244
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		116.700.001	(21.553.891)	116.563.007
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		273.552.544	48.071.631	781.310.305
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(438.917.785)	(186.846.813)	(2.622.225.777)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(165.365.241)	(138.775.182)	(1.840.915.472)
Dividendes déclarés	15	(224.211)	(11)	(48.303.128)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		724.576.156	255.313.096	7.224.434.913

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Future Consumer Fund USD	Future Of Transport Fund USD	Global Allocation Fund USD
Actif net au début de l'exercice		11.978.939	1.603.226.338	15.096.811.718
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	21.569	4.423.242	7.871.309
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	259.728.067
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	33.911.443
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	6.085.802
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	9.485.987
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	244.153
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	80.547	19.955.061	132.026.774
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	21.162
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	781	263.020	3.580.255
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	27.921
Autres remboursements	10	109	5.371	60.690
Total des revenus	2(b)	103.006	24.646.694	453.043.563
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	20.617.760
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	4.527.005
Frais de gestion annuels	6	(4.193)	3.605.563	26.727.093
Commissions d'engagement de prêt	16	34	4.495	45.211
Commissions du Dépositaire	2(h),7	12.034	265.667	1.794.818
Commissions de distribution	5	1.497	3.609.009	14.088.725
Impôt	8	1.434	737.403	6.379.364
Commissions de gestion	4	7.576	21.152.567	181.432.387
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		18.382	29.374.704	255.612.363
Revenu/(déficit) net		84.624	(4.728.010)	197.431.200
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(2.202.306)	(35.020.821)	(32.087.780)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	(19.687.135)
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	(25.171.502)
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	(66.106.311)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	68.578.153
Opérations de swap	2(c)	–	–	(129.249.995)
Contrats de change à terme	2(c)	–	10.562.437	1.249.433
Autres opérations de change	2(i)	1.012	(628.032)	14.730.566
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(2.201.294)	(25.086.416)	(187.744.571)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	2.916.945	144.290.677	708.298.430
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	1.164.722
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	(1.568.236)
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	32.457.417
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	7.951.698
Opérations de swap	2(c)	–	–	38.830.171
Contrats de change à terme	2(c)	–	4.218.130	53.364.185
Autres opérations de change	2(i)	3	26.654	1.598.251
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		2.916.948	148.535.461	842.096.638
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		800.278	118.721.035	851.783.267
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		301.697	779.163.734	1.844.669.591
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(139.683)	(672.952.217)	(3.309.238.264)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		162.014	106.211.517	(1.464.568.673)
Dividendes déclarés	15	–	(38.171)	(28.749.416)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		12.941.231	1.828.120.719	14.455.276.896

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Global Corporate Bond Fund USD	Global Dynamic Equity Fund USD	Global Equity Income Fund USD
Actif net au début de l'exercice		801.859.454	453.941.160	939.683.090
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	1.440.863	1.440.233	670.819
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	37.088.150	130	-
Intérêts sur swaps	2(c)	1.046.627	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	45.533	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	913.152	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	5.990.095	21.886.580
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	90.232	80.080	102.094
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	6.132	2.627	1.422
Total des revenus	2(b)	40.585.156	7.558.698	22.660.915
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	2.479.358	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	21.248	-
Frais de gestion annuels	6	958.070	953.750	1.987.827
Commissions d'engagement de prêt	16	2.420	1.329	2.750
Commissions du Dépositaire	2(h),7	139.653	115.586	123.901
Commissions de distribution	5	74.697	610.296	809.308
Impôt	8	328.684	186.260	388.332
Commissions de gestion	4	5.006.479	5.382.928	11.790.804
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		8.989.361	7.271.397	15.102.922
Revenu/(déficit) net		31.595.795	287.301	7.557.993
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(64.288.968)	6.656.130	(6.227.940)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	(56.317)	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(7.187.164)	311.712	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(353.009)	2.808.884	-
Opérations de swap	2(c)	(9.139.594)	12.669	-
Contrats de change à terme	2(c)	(10.976.077)	(1.235.423)	2.557.243
Autres opérations de change	2(i)	391.097	2.043	(49.393)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(91.553.715)	8.499.698	(3.720.090)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	86.859.150	29.587.509	95.417.015
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	122.574	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(1.394.199)	931.430	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(270.518)	1.338.500	-
Opérations de swap	2(c)	3.381.762	(12.669)	-
Contrats de change à terme	2(c)	617.222	(272.273)	1.772.134
Autres opérations de change	2(i)	1.360.701	28.217	63.237
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		90.554.118	31.723.288	97.252.386
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		30.596.198	40.510.287	101.090.289
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		516.927.402	109.644.409	216.487.808
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(462.211.353)	(195.094.808)	(330.081.199)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		54.716.049	(85.450.399)	(113.593.391)
Dividendes déclarés	15	(8.364.841)	(70.459)	(8.004.613)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		878.806.860	408.930.589	919.175.375

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Global Government Bond Fund	Global High Yield Bond Fund	Global Inflation Linked Bond Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		845.281.585	1.694.518.231	364.440.108
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	1.089.552	2.403.436	43.642
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	26.748.892	100.219.447	2.838.873
Intérêts sur swaps	2(c)	2.815.400	2.439.417	785.462
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	299.207	178.752
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	146.578	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	96.136	544.145	6.716
Remise sur la commission de gestion	4	–	26.962	535
Autres remboursements	10	1.087	6.524	566
Total des revenus	2(b)	30.751.067	106.085.716	3.854.546
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	2.906.193	100.406	728.315
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	1.052.682	1.758.399	447.887
Commissions d'engagement de prêt	16	2.569	5.088	1.084
Commissions du Dépositaire	2(h),7	237.514	216.090	80.952
Commissions de distribution	5	549.140	980.339	843.411
Impôt	8	351.831	577.252	142.322
Commissions de gestion	4	4.292.905	13.847.286	2.010.975
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		9.392.834	17.484.860	4.254.946
Revenu/(déficit) net		21.358.233	88.600.856	(400.400)
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(41.590.726)	(126.978.312)	(15.532.438)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	(1.134.586)	–	(1.057.942)
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(14.299.393)	(1.977.381)	2.477.007
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(1.712.859)	(920.143)	24.463
Opérations de swap	2(c)	(7.568.707)	(11.358.330)	(873.959)
Contrats de change à terme	2(c)	13.792.119	(1.070.932)	6.034.201
Autres opérations de change	2(i)	661.505	(1.902.729)	238.555
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(51.852.647)	(144.207.827)	(8.690.113)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	26.440.489	155.726.576	10.048.487
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	(306.373)	–	115.279
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	234.283	104.959	(157.194)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(21.327)	38.947	(123.814)
Opérations de swap	2(c)	2.185.642	6.557.073	251.967
Contrats de change à terme	2(c)	364.337	8.614.867	93.064
Autres opérations de change	2(i)	(58.927)	198.604	31.268
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		28.838.124	171.241.026	10.259.057
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(1.656.290)	115.634.055	1.168.544
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		690.961.795	492.324.356	39.295.487
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(514.443.748)	(604.374.050)	(134.617.393)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		176.518.047	(112.049.694)	(95.321.906)
Dividendes déclarés	15	(698.923)	(34.192.006)	(332)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		1.019.444.419	1.663.910.586	270.286.414

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Global Long-Horizon Equity Fund USD	Global Multi-Asset Income Fund USD	Impact Bond Fund ⁽²⁾ EUR
Actif net au début de l'exercice		1.063.272.581	5.435.956.493	-
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	1.036.352	10.536.703	9.849
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	176.345.946	2.732.249
Intérêts sur swaps	2(c)	-	239.644	38.935
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	61.532.339	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	14.241.089	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	10.720.345	34.209.887	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	82.995	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	28.028	916.200	223
Remise sur la commission de gestion	4	-	833.718	-
Autres remboursements	10	657	39.669	180
Total des revenus	2(b)	11.785.382	298.978.190	2.781.436
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	92.758	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	94.084	46.161
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	720	-
Frais de gestion annuels	6	2.850.307	10.379.530	20.574
Commissions d'engagement de prêt	16	3.077	16.312	-
Commissions du Dépositaire	2(h),7	143.506	996.847	34.857
Commissions de distribution	5	1.007.903	3.114.049	12
Impôt	8	588.777	2.397.094	6.987
Commissions de gestion	4	15.487.931	65.844.915	104
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		20.081.501	82.936.309	108.695
Revenu/(déficit) net		(8.296.119)	216.041.881	2.672.741
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(7.568.419)	(290.249.372)	(638.853)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	883.051	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	(49.758.948)	410.042
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	834.044	-
Opérations de swap	2(c)	-	(931.457)	81.337
Contrats de change à terme	2(c)	385	2.737	2.044.032
Autres opérations de change	2(i)	(5.856)	13.051.110	(209.604)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(7.573.890)	(326.168.835)	1.686.954
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	128.599.641	287.892.119	(2.575.388)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	824.418	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	(9.012.465)	(35.191)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	(651.759)	-
Opérations de swap	2(c)	-	505.715	(14.375)
Contrats de change à terme	2(c)	514	14.900.571	(438.683)
Autres opérations de change	2(i)	27.742	263.665	(1.446)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		128.627.897	294.722.264	(3.065.083)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		112.757.888	184.595.310	1.294.612
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		424.457.382	494.016.381	75.004.762
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(215.419.999)	(1.031.825.111)	(70)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		209.037.383	(537.808.730)	75.004.692
Dividendes déclarés	15	-	(241.866.696)	-
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		1.385.067.852	4.840.876.377	76.299.304

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	India Fund USD	Japan Flexible Equity Fund JPY	Japan Small & MidCap Opportunities Fund JPY
Actif net au début de l'exercice		451.125.592	29.089.575.077	20.235.105.162
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	80.758	-	-
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	3.865.976	581.249.901	393.133.286
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	-	7.285.936	15.745.155
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	-	-	-
Total des revenus	2(b)	3.946.734	588.535.837	408.878.441
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	2.970.459	961.612
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	800.756	58.971.145	47.522.228
Commissions d'engagement de prêt	16	1.331	87.056	58.455
Commissions du Dépositaire	2(h),7	235.752	4.823.513	5.390.109
Commissions de distribution	5	267.813	45.819.944	7.205.869
Impôt	8	168.524	12.123.566	9.589.886
Commissions de gestion	4	5.266.284	326.178.297	262.689.467
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		6.740.460	450.973.980	333.417.626
Revenu/(déficit) net		(2.793.726)	137.561.857	75.460.815
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(5.730.929)	2.113.338.740	314.416.712
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	8	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	-	911.261.077	162.252.660
Autres opérations de change	2(i)	(749.362)	(7.803.154)	(2.941.772)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(6.480.283)	3.016.796.663	473.727.600
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	26.993.841	4.010.267.120	1.757.410.227
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	-	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	-	-
Contrats de change à terme	2(c)	-	60.589.369	(6.874.901)
Autres opérations de change	2(i)	(70.136)	104.150	5.183.221
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		26.923.705	4.070.960.639	1.755.718.547
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		17.649.696	7.225.319.159	2.304.906.962
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		150.335.159	33.207.820.984	6.202.800.959
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(149.356.854)	(34.491.034.714)	(7.287.480.296)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		978.305	(1.283.213.730)	(1.084.679.337)
Dividendes déclarés	15	-	(1.538.341)	(244.649)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		469.753.593	35.030.142.165	21.455.088.138

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Latin American Fund	Multi-Theme Equity Fund	Natural Resources Fund ⁽⁷⁾
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		835.233.169	188.867.921	444.508.211
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	581.243	14.605	603.415
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	2.219	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	578.266	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	52.770.182	–	13.863.728
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	51.150	–	147.593
Remise sur la commission de gestion	4	–	581.236	–
Autres remboursements	10	–	540	1.879
Total des revenus	2(b)	53.404.794	1.174.647	14.616.615
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	2.061.842	223.040	861.594
Commissions d'engagement de prêt	16	2.559	545	1.393
Commissions du Dépositaire	2(h),7	283.774	57.586	90.732
Commissions de distribution	5	143.563	130.379	483.185
Impôt	8	415.878	46.702	172.609
Commissions de gestion	4	13.776.537	1.093.814	5.758.055
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		16.684.153	1.552.066	7.367.568
Revenu/(déficit) net		36.720.641	(377.419)	7.249.047
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	53.517.421	(6.432.647)	10.426.695
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	978.087	(947.655)	2.019.472
Autres opérations de change	2(i)	604.616	70.514	(74.386)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		55.100.124	(7.309.788)	12.371.781
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	85.670.023	16.194.562	13.411.901
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	(99.685)	1.891.673	596.544
Autres opérations de change	2(i)	21.298	(15)	32.003
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		85.591.636	18.086.220	14.040.448
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		177.412.401	10.399.013	33.661.276
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		293.257.830	47.349.251	176.677.329
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(369.073.522)	(82.370.066)	(274.087.650)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(75.815.692)	(35.020.815)	(97.410.321)
Dividendes déclarés	15	(205.553)	–	(4.088.098)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		936.624.325	164.246.119	376.671.068

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Next Generation Health Care Fund	Next Generation Technology Fund	Nutrition Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		16.685.032	2.755.606.835	348.357.484
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	40.752	3.246.910	749.282
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	49.609	12.126.457	3.747.947
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	3.803	556.067	37.236
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	–
Autres remboursements	10	38	14.626	1.159
Total des revenus	2(b)	94.202	15.944.060	4.535.624
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	(6.020)	5.332.356	519.542
Commissions d'engagement de prêt	16	50	7.651	955
Commissions du Dépositaire	2(h),7	18.724	374.501	66.518
Commissions de distribution	5	3.506	3.974.501	613.097
Impôt	8	2.375	1.102.319	105.646
Commissions de gestion	4	18.968	30.355.294	3.300.937
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		37.603	41.146.622	4.606.695
Revenu/(déficit) net		56.599	(25.202.562)	(71.071)
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(1.044.416)	(699.577.724)	(34.532.843)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	9.243	18.017.039	888.881
Autres opérations de change	2(i)	(2.936)	(1.089.396)	(110.577)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(1.038.109)	(682.650.081)	(33.754.539)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	2.382.508	829.161.453	13.822.110
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	(9.965)	10.043.217	501.915
Autres opérations de change	2(i)	178	1.580	(8.912)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		2.372.721	839.206.250	14.315.113
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		1.391.211	131.353.607	(19.510.497)
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		997.859	582.547.289	59.936.611
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(702.973)	(903.990.994)	(118.462.216)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		294.886	(321.443.705)	(58.525.605)
Dividendes déclarés	15	–	(317)	(4.879)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		18.371.129	2.565.516.420	270.316.503

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Sustainable Asian Bond Fund USD	Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund USD	Sustainable Emerging Markets Bond Fund USD
Actif net au début de l'exercice		42.880.627	43.855.487	352.748.965
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	214.585	52.976	859.010
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	3.903.191	2.620.528	16.510.461
Intérêts sur swaps	2(c)	18.675	124.911	13.625
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	18.444	8.360	132.612
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	755	(178)	1.992
Total des revenus	2(b)	4.155.650	2.806.597	17.517.700
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	15.648	264.549	655.504
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	23.726	(12.611)	140.012
Commissions d'engagement de prêt	16	132	134	1.059
Commissions du Dépositaire	2(h),7	24.901	61.946	75.967
Commissions de distribution	5	410	48.330	49.822
Impôt	8	8.331	12.418	50.810
Commissions de gestion	4	302.191	172.272	1.458.801
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		375.339	547.038	2.431.975
Revenu/(déficit) net		3.780.311	2.259.559	15.085.725
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(5.442.539)	(1.940.746)	(63.235.700)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(727.715)	(161.811)	6.596.000
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(80.037)	63.088	-
Opérations de swap	2(c)	(122.525)	239.546	553.495
Contrats de change à terme	2(c)	92.251	158.999	13.856.655
Autres opérations de change	2(i)	(27.813)	(6.894)	41.001
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(6.308.378)	(1.647.818)	(42.188.549)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	1.458.361	4.266.836	65.055.900
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	-	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	88.982	66.808	531
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(16.217)	23.629	-
Opérations de swap	2(c)	19.056	(179.325)	(1.095.169)
Contrats de change à terme	2(c)	204.739	(177.312)	3.782.692
Autres opérations de change	2(i)	1.130	16.912	21.832
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		1.756.051	4.017.548	67.765.786
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(772.016)	4.629.289	40.662.962
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		75.127.152	1.226.581	70.499.059
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(5.003.692)	(6.902.704)	(247.718.304)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		70.123.460	(5.676.123)	(177.219.245)
Dividendes déclarés	15	(525)	(11.343)	(133.524)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		112.231.546	42.797.310	216.059.158

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Sustainable Energy Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		79.198.715	429.926.735	6.450.497.616
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	112.364	312.351	15.103.026
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	3.368.940	30.225.167	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	523.329	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	-	-	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	91.976.739
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	55.464	49.536	1.094.512
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	168	(33.288)	35.811
Total des revenus	2(b)	3.536.936	31.077.095	108.210.088
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	35.096	482.685	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	28.065	140.815	14.633.929
Commissions d'engagement de prêt	16	230	1.284	18.606
Commissions du Dépositaire	2(h),7	21.114	383.099	1.024.649
Commissions de distribution	5	28.765	5.072	9.359.758
Impôt	8	12.446	48.092	3.078.062
Commissions de gestion	4	310.569	728.751	97.013.965
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		436.285	1.789.798	125.128.969
Revenu/(déficit) net		3.100.651	29.287.297	(16.918.881)
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements				
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(a)	(8.374.349)	(34.574.231)	197.955.799
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(53.455)	(608.199)	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	(312.123)	-
Opérations de swap	2(c)	67.664	(679.026)	-
Contrats de change à terme	2(c)	785.754	(1.035.786)	4.209.567
Autres opérations de change	2(i)	76.922	1.231.429	(654.675)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(7.497.464)	(35.977.936)	201.510.691
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements				
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(a)	6.384.482	69.180.182	586.532.344
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	19.969	115.876	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	151.526	-
Opérations de swap	2(c)	(66.476)	856.886	-
Contrats de change à terme	2(c)	627.036	(2.229.317)	2.725.611
Autres opérations de change	2(i)	5.903	504.527	32.542
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		6.970.914	68.579.680	589.290.497
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		2.574.101	61.889.041	773.882.307
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		28.515.103	106.774.037	1.416.439.233
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(57.145.252)	(91.702.291)	(1.699.489.184)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(28.630.149)	15.071.746	(283.049.951)
Dividendes déclarés	15	(15.654)	(2.525)	(1.472.062)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		53.127.013	506.884.997	6.939.857.910

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	Sustainable Global Allocation Fund ⁽²⁾	Sustainable Global Bond Income Fund
		EUR	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		565.937.527	-	120.102.371
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	1.463.533	234.494	303.013
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	22.047.496	973.559	5.789.779
Intérêts sur swaps	2(c)	18.289.431	120.827	621.653
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	237.460	159.582	79.498
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	7.618	-	1.492
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	218.307	672.816	256.780
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	102	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	27.491	-	5.940
Remise sur la commission de gestion	4	356	-	83
Autres remboursements	10	1.362	91	107
Total des revenus	2(b)	42.293.156	2.161.369	7.058.345
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	21.408.837	146.468	633.419
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	330	-	-
Frais de gestion annuels	6	131.339	(6.596)	61.300
Commissions d'engagement de prêt	16	2.025	-	371
Commissions du Dépositaire	2(h),7	135.424	32.424	38.819
Commissions de distribution	5	11.549	51	15.486
Impôt	8	52.965	8.830	19.942
Commissions de gestion	4	499.067	67.445	400.844
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		22.241.536	248.622	1.170.181
Revenu/(déficit) net		20.051.620	1.912.747	5.888.164
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(30.123.685)	2.271.852	(6.558.326)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	2.343.439	(146.593)	(132.285)
« Contracts for difference »	2(c)	(7.099)	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	9.107.817	(334.435)	316.362
Contrats d'options/swaptions	2(c)	755.262	313.587	52.943
Opérations de swap	2(c)	3.184.071	(38.267)	(261.979)
Contrats de change à terme	2(c)	(27.662.823)	(245.820)	3.165.774
Autres opérations de change	2(i)	5.408.484	57.936	(218.598)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(36.994.534)	1.878.260	(3.636.109)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	(20.375.500)	7.433.824	5.751.602
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	180.331	(24.939)	(53.568)
« Contracts for difference »	2(c)	23.418	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(1.975.516)	(3.630)	(307.408)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	1.007.323	45.873	58.139
Opérations de swap	2(c)	(3.743.224)	34.637	265.605
Contrats de change à terme	2(c)	22.019.280	(499.048)	(553)
Autres opérations de change	2(i)	(2.687.361)	(2.422)	15.867
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		(5.551.249)	6.984.295	5.729.684
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(22.494.163)	10.775.302	7.981.739
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		48.121.687	88.144.219	13.987.897
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(75.138.475)	(2.998.288)	(28.930.746)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(27.016.788)	85.145.931	(14.942.849)
Dividendes déclarés	15	(9.652.721)	(40)	(1.775.348)
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		506.773.855	95.921.193	111.365.913

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Sustainable Global Infrastructure Fund	Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾	Swiss Small & MidCap Opportunities Fund ⁽⁵⁾
		USD	USD	CHF
Actif net au début de l'exercice		10.453.305	1.128.318.997	707.399.037
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	28.293	1.158.313	–
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	34.684.916	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	5.812.087	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	36.547	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	205.343	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	291.759	–	7.942.179
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	807	175.306	232.721
Remise sur la commission de gestion	4	–	1.670	1.675
Autres remboursements	10	78	5.079	17
Total des revenus	2(b)	320.937	42.079.261	8.176.592
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	51.814
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	6.957.630	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	6.388	737.275	1.106.187
Commissions d'engagement de prêt	16	30	3.489	1.995
Commissions du Dépositaire	2(h),7	16.161	270.070	104.336
Commissions de distribution	5	6.302	179.737	–
Impôt	8	1.739	239.198	223.570
Commissions de gestion	4	16.648	2.379.444	6.519.433
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		47.268	10.766.843	8.007.335
Revenu/(déficit) net		273.669	31.312.418	169.257
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(401.384)	(82.097.146)	72.388.273
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	(2.731.725)	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	(4.933.835)	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	1.581.322	–
Opérations de swap	2(c)	–	(8.108.082)	–
Contrats de change à terme	2(c)	–	1.116.255	–
Autres opérations de change	2(i)	4.207	3.113.270	(55)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(397.177)	(92.059.941)	72.388.218
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	220.299	74.347.463	(41.402.323)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	266.230	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	(1.829.443)	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	115.518	–
Opérations de swap	2(c)	–	(994.532)	–
Contrats de change à terme	2(c)	–	4.392.008	–
Autres opérations de change	2(i)	(421)	(27.679)	(701)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		219.878	76.269.565	(41.403.024)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		96.370	15.522.042	31.154.451
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		1.323.824	174.137.025	1.137.003
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(231.051)	(391.444.708)	(138.937.182)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		1.092.773	(217.307.683)	(137.800.179)
Dividendes déclarés	15	–	(1.207.239)	(10.047)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		11.642.448	925.326.117	600.743.262

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Systematic China A-Share Opportunities Fund	Systematic China Environmental Tech Fund ⁽²⁾	Systematic Global Equity High Income Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		562.981.457	–	4.369.623.100
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	271.819	3.942	8.634.126
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	13.327.439	131.735	135.427.144
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	–	–	2.548.157
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	–
Autres remboursements	10	–	–	9.438
Total des revenus	2(b)	13.599.258	135.677	146.618.865
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	754.295	(4.092)	9.673.501
Commissions d'engagement de prêt	16	1.751	–	12.815
Commissions du Dépositaire	2(h),7	391.349	8.911	613.763
Commissions de distribution	5	8.745	–	90.812
Impôt	8	156.721	664	2.011.803
Commissions de gestion	4	3.650.516	64	58.676.619
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		4.963.377	5.547	71.079.313
Revenu/(déficit) net		8.635.881	130.130	75.539.552
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(89.992.546)	(58.972)	(265.697.896)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(518.460)	(2.982)	41.915.986
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	158.019.757
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	186.628	8	(61.460.563)
Autres opérations de change	2(i)	37.101	3.223	1.553.489
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(90.287.277)	(58.723)	(125.669.227)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	4.677.532	(570.712)	377.966.672
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	124.052	2.515	17.162.658
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	(21.259.238)
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	157.266	(54)	10.805.422
Autres opérations de change	2(i)	6.791	(20)	525.257
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		4.965.641	(568.271)	385.200.771
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(76.685.755)	(496.864)	335.071.096
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		228.402.173	16.600.133	3.567.211.114
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(166.574.123)	(21)	(2.914.995.940)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		61.828.050	16.600.112	652.215.174
Dividendes déclarés	15	–	–	(348.199.443)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		548.123.752	16.103.248	5.008.709.927

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund ⁽²⁾	Systematic Sustainable Global SmallCap Fund ⁽⁴⁾	United Kingdom Fund
		USD	USD	GBP
Actif net au début de l'exercice		–	222.047.023	269.647.969
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	36.793	188.718	74.688
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	208.266	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	310.793	4.968.706	6.244.799
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	973	130.767	5.024
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	–
Autres remboursements	10	2	640	–
Total des revenus	2(b)	556.827	5.288.831	6.324.511
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	(34.456)	421.487	520.519
Commissions d'engagement de prêt	16	–	645	763
Commissions du Dépositaire	2(h),7	46.564	326.404	38.098
Commissions de distribution	5	13	137.983	219.716
Impôt	8	2.740	119.584	100.462
Commissions de gestion	4	8.662	3.344.256	2.963.538
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		23.523	4.350.359	3.843.096
Revenu/(déficit) net		533.304	938.472	2.481.415
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	9.335	(6.401.525)	(1.861.290)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	214.213	84.043	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	419.230	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	859	(477.059)	560.079
Autres opérations de change	2(i)	(722)	(106.414)	(39.457)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		642.915	(6.900.955)	(1.340.668)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	808.132	30.585.385	12.632.398
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	54.304	107.485	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(64.867)	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	1.057	392.340	48.106
Autres opérations de change	2(i)	797	10.092	(7.084)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		799.423	31.095.302	12.673.420
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		1.975.642	25.132.819	13.814.167
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		20.137.552	54.554.182	21.244.001
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(40.772)	(46.449.260)	(91.469.599)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		20.096.780	8.104.922	(70.225.598)
Dividendes déclarés	15	(77.994)	–	(434.832)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		21.994.428	255.284.764	212.801.706

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	US Basic Value Fund USD	US Dollar Bond Fund USD	US Dollar High Yield Bond Fund USD
Actif net au début de l'exercice		759.596.354	572.662.883	2.357.372.193
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	1.699.331	1.759.569	2.226.153
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	19.393.307	129.454.302
Intérêts sur swaps	2(c)	–	447.021	1.512.143
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	10.829	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	(1.465)
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	15.792.456	–	648.520
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	80.364	12.970	557.461
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	10.918
Autres remboursements	10	4.838	(12)	5.245
Total des revenus	2(b)	17.576.989	21.623.684	134.413.277
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	491.498	18.006
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	1.686.116	502.194	2.433.459
Commissions d'engagement de prêt	16	2.403	1.685	7.092
Commissions du Dépositaire	2(h),7	116.835	168.092	225.787
Commissions de distribution	5	558.392	186.234	196.635
Impôt	8	347.162	186.415	783.295
Commissions de gestion	4	9.567.118	2.851.292	19.060.743
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		12.278.026	4.387.410	22.725.017
Revenu/(déficit) net		5.298.963	17.236.274	111.688.260
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	27.626.214	(25.538.436)	(141.478.548)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	(1.653.063)	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	(2.897.890)	(3.520.342)
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	(1.657.356)	(284.757)
Opérations de swap	2(c)	–	(93.898)	(17.381.781)
Contrats de change à terme	2(c)	552.575	2.266.249	659.890
Autres opérations de change	2(i)	128.340	(190.333)	(456.021)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		28.307.129	(29.764.727)	(162.461.559)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	22.265.164	5.042.655	157.571.324
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	377.081	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	(543.345)	203.897
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	(184.181)	(149.120)
Opérations de swap	2(c)	–	(217.373)	9.374.903
Contrats de change à terme	2(c)	365.715	(204.013)	(1.615.688)
Autres opérations de change	2(i)	166	32.016	(2.704)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		22.631.045	4.302.840	165.382.612
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		56.237.137	(8.225.613)	114.609.313
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		379.622.222	258.208.562	631.111.452
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(305.574.883)	(266.681.671)	(1.151.559.738)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		74.047.339	(8.473.109)	(520.448.286)
Dividendes déclarés	15	(110.907)	(2.297.426)	(65.645.476)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		889.769.923	553.666.735	1.885.887.744

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	US Dollar	US Dollar	US Flexible
		Reserve Fund USD	Short Duration Bond Fund USD	Equity Fund USD
Actif net au début de l'exercice		505.636.900	1.582.256.819	1.544.907.233
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	1.840	1.628.778	809.365
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	9.005.967	63.406.089	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	410.228	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	-	-	-
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	12.928.904	2.031.114	-
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	-	-	-
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	302	-	13.413.336
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	-	163.704	90.791
Remise sur la commission de gestion	4	-	-	-
Autres remboursements	10	-	4.360	-
Total des revenus	2(b)	21.937.013	67.644.273	14.313.492
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	-	-	-
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Intérêts sur swaps	2(c)	-	801.424	-
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	-	-	-
Frais de gestion annuels	6	372.291	1.111.487	2.579.954
Commissions d'engagement de prêt	16	-	4.937	4.225
Commissions du Dépositaire	2(h),7	64.738	200.783	187.645
Commissions de distribution	5	69.638	682.339	537.424
Impôt	8	51.364	724.713	539.536
Commissions de gestion	4	2.215.239	8.489.762	16.304.879
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	-	-	-
Frais totaux		2.773.270	12.015.445	20.153.663
Revenu/(déficit) net		19.163.743	55.628.828	(5.840.171)
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	1.038.091	(58.266.286)	45.192.792
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	(271.737)	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	(4.587.947)	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	644.316	-
Contrats de change à terme	2(c)	744.526	8.848.084	3.094.293
Autres opérations de change	2(i)	(11.354)	(493.621)	(343.843)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		1.771.263	(54.127.191)	47.943.242
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	53.518	54.562.737	142.138.183
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	-	(121.542)	-
« Contracts for difference »	2(c)	-	-	-
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	-	(1.819.850)	-
Contrats d'options/swaptions	2(c)	-	-	-
Opérations de swap	2(c)	-	(496.761)	-
Contrats de change à terme	2(c)	589.414	(12.855.081)	792.007
Autres opérations de change	2(i)	(307)	32.040	(7.628)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		642.625	39.301.543	142.922.562
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		21.577.631	40.803.180	185.025.633
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		911.220.226	749.669.561	785.407.099
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(923.854.581)	(749.450.072)	(633.592.214)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(12.634.355)	219.489	151.814.885
Dividendes déclarés	15	-	(5.156.910)	-
Ajustement de change	2(e)	-	-	-
Actif net à la clôture de l'exercice		514.580.176	1.618.122.578	1.881.747.751

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	US Government	US Growth	US Mid-Cap
		Mortgage Impact Fund	Fund	Value Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		101.674.992	310.964.654	264.640.243
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	21.984	149.939	599.540
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	3.348.100	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	1.423.435	4.035.989
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	–	22.934	39.403
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	–
Autres remboursements	10	–	630	1.462
Total des revenus	2(b)	3.370.084	1.596.938	4.676.394
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	116.414	722.505	648.495
Commissions d'engagement de prêt	16	324	933	795
Commissions du Dépositaire	2(h),7	51.996	41.981	70.715
Commissions de distribution	5	76.154	408.389	221.121
Impôt	8	38.976	149.978	127.509
Commissions de gestion	4	512.013	3.941.495	3.543.209
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		795.877	5.265.281	4.611.844
Revenu/(déficit) net		2.574.207	(3.668.343)	64.550
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(3.045.139)	(2.446.176)	324.687
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	(268.685)	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	491.995	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	3.004	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	371	302.735	(147.393)
Autres opérations de change	2(i)	134	(15.958)	(28.148)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(2.818.320)	(2.159.399)	149.146
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	(3.372.911)	72.301.426	14.555.830
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	(115.160)	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	(80.573)	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	(9.547)	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	(62)	(78.355)	26.861
Autres opérations de change	2(i)	31	36	4.169
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		(3.578.222)	72.223.107	14.586.860
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(3.822.335)	66.395.365	14.800.556
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		15.509.628	156.142.468	116.969.346
Paievements nets résultant du rachat d'actions		(25.885.814)	(141.438.777)	(153.019.994)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(10.376.186)	14.703.691	(36.050.648)
Dividendes déclarés	15	(300.789)	–	–
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		87.175.682	392.063.710	243.390.151

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	US Sustainable	World	World
		Equity Fund	Energy Fund	Financials Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		4.276.723	3.014.573.608	1.419.083.947
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	4.314	1.846.914	2.172.592
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	39.972	113.986.110	50.941.533
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	947.148
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	363	1.581.115	113.065
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	–
Autres remboursements	10	66	35.989	9.473
Total des revenus	2(b)	44.715	117.450.128	54.183.811
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	(7.462)	6.906.259	3.725.457
Commissions d'engagement de prêt	16	12	9.284	4.251
Commissions du Dépositaire	2(h),7	10.080	375.915	600.244
Commissions de distribution	5	525	1.293.733	1.780.594
Impôt	8	492	1.329.403	731.501
Commissions de gestion	4	1.779	49.583.736	21.291.173
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		5.426	59.498.330	28.133.220
Revenu/(déficit) net		39.289	57.951.798	26.050.591
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	(212.553)	250.961.954	(134.871.291)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	5.940.381
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	–	6.445.222	156.263
Autres opérations de change	2(i)	(131)	(10.783)	73.243
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(212.684)	257.396.393	(128.701.404)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	646.429	24.907.538	416.173.833
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	–	2.494.000	537.894
Autres opérations de change	2(i)	54	171.763	161.117
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		646.483	27.573.301	416.872.844
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		473.088	342.921.492	314.222.031
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		157.448	2.352.677.207	917.261.477
Paievements nets résultant du rachat d'actions		(89.906)	(2.717.740.548)	(858.467.546)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		67.542	(365.063.341)	58.793.931
Dividendes déclarés	15	–	(2.347.688)	(490.374)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		4.817.353	2.990.084.071	1.791.609.535

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	World Gold Fund	World Healthscience Fund	World Mining Fund
		USD	USD	USD
Actif net au début de l'exercice		3.351.047.354	13.872.428.365	5.369.730.517
Revenus				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	2.398.915	753.968	3.747.919
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	12.129.995	–
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	76.754.500	164.420.590	199.926.058
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	1.188.152	1.290.929	1.393.168
Remise sur la commission de gestion	4	–	–	–
Autres remboursements	10	(45)	8.670	17.949
Total des revenus	2(b)	80.341.522	178.604.152	205.085.094
Frais				
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–	–
Frais de gestion annuels	6	9.519.583	28.469.401	13.295.676
Commissions d'engagement de prêt	16	11.049	43.318	16.626
Commissions du Dépositaire	2(h),7	588.590	1.474.488	920.324
Commissions de distribution	5	2.013.632	15.604.882	2.181.968
Impôt	8	1.949.933	6.481.523	2.658.516
Commissions de gestion	4	65.504.769	187.666.975	93.267.574
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–	–
Frais totaux		79.587.556	239.740.587	112.340.684
Revenu/(déficit) net		753.966	(61.136.435)	92.744.410
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:				
Placements	2(a)	109.760.740	243.643.956	367.969.292
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	2.192.198	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	10.467.812	(9.154.552)	6.990.663
Autres opérations de change	2(i)	(425.789)	(35.744)	(3.795.502)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		119.802.763	236.645.858	371.164.453
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:				
Placements	2(a)	708.438.461	1.095.239.556	180.603.785
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	–	–	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	2.891.530	(22.841.472)	5.406.895
Autres opérations de change	2(i)	53.240	143.662	525.953
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		711.383.231	1.072.541.746	186.536.633
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		831.939.960	1.248.051.169	650.445.496
Mouvements du capital social				
Encaissement net sur l'émission d'actions		1.492.090.919	3.598.057.269	1.312.342.710
Paievements nets résultant du rachat d'actions		(1.693.743.776)	(5.106.265.684)	(1.919.112.010)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		(201.652.857)	(1.508.208.415)	(606.769.300)
Dividendes déclarés	15	(77.747)	(465.545)	(3.725.117)
Ajustement de change	2(e)	–	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		3.981.256.710	13.611.805.574	5.409.681.596

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Compte de résultat et évolution de l'actif net

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

Nom du Compartiment	Note	World Real Estate Securities Fund	World Technology Fund
		USD	USD
Actif net au début de l'exercice		146.252.232	8.792.222.507
Revenus			
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	266.346	452.162
Intérêts obligataires, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	–	–
Revenu des obligations indexées à des actions	2(c)	–	–
Intérêt issu des dépôts du marché monétaire	2(b)	–	–
Revenus d'organismes de placement collectif, après déduction des retenues à la source	2(b)	–	11.501.949
Dividendes, après déduction des retenues à la source	2(b)	3.712.024	34.243.946
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	27.709	–
Revenus sur les prêts de titres	2(b)	23.478	1.349.054
Remise sur la commission de gestion	4	–	–
Autres remboursements	10	87	22.982
Total des revenus	2(b)	4.029.644	47.570.093
Frais			
Intérêts sur les liquidités et quasi-liquidités	2(b)	–	–
Intérêts sur « Contracts for difference »	2(c)	67.620	–
Intérêts sur swaps	2(c)	–	–
Dividendes des « Contracts for difference », après déduction des retenues à la source	2(c)	–	–
Frais de gestion annuels	6	267.856	18.208.203
Commissions d'engagement de prêt	16	423	24.586
Commissions du Dépositaire	2(h),7	65.948	913.314
Commissions de distribution	5	52.306	8.833.124
Impôt	8	56.741	4.005.977
Commissions de gestion	4	1.328.512	112.310.659
Moins la renonciation aux commissions de gestion	4	–	–
Frais totaux		1.839.406	144.295.863
Revenu/(déficit) net		2.190.238	(96.725.770)
Plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur:			
Placements	2(a)	(13.536.369)	(732.661.122)
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	21.765	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	190.546	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	35.317	(4.392.379)
Autres opérations de change	2(i)	140.397	(1.460.634)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée pour l'exercice		(13.148.344)	(738.514.135)
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées sur:			
Placements	2(a)	37.110	2.175.910.109
Contrats sur titres à déterminer (TBAs)	2(c)	–	–
« Contracts for difference »	2(c)	190.546	–
Contrats à terme négociés en bourse	2(c)	–	–
Contrats d'options/swaptions	2(c)	–	–
Opérations de swap	2(c)	–	–
Contrats de change à terme	2(c)	(277.482)	3.942.879
Autres opérations de change	2(i)	(984)	6.902
Variation nette des plus-values/(moins-values) non réalisées pour l'exercice		(50.810)	2.179.859.890
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant d'opérations		(11.008.916)	1.344.619.985
Mouvements du capital social			
Encaissement net sur l'émission d'actions		105.465.030	2.628.393.957
Paiements nets résultant du rachat d'actions		(42.595.527)	(2.965.786.635)
Augmentation/(diminution) de l'actif net résultant de mouvements du capital social		62.869.503	(337.392.678)
Dividendes déclarés	15	(219.051)	(661.162)
Ajustement de change	2(e)	–	–
Actif net à la clôture de l'exercice		197.893.768	9.798.788.652

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Asia Pacific Equity Income Fund⁽¹⁾				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR	426.177	15.597	441.774	–
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	804.834	990	805.824	–
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD	4.831.447	154.799	4.986.246	–
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	644.341	6.577	650.918	–
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	309.116	35.730	344.846	–
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	19.102	801	19.903	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	822.964	22.345	845.309	–
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	264.130	713	264.843	–
Action de capitalisation de Catégorie A	1.564.048	167.917	1.731.965	–
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	30.757	719	31.476	–
Action de Catégorie C de distribution (Q) (G)	32.926	111	33.037	–
Action de Catégorie C de distribution (Q) (G) couverte en SGD	24.004	–	24.004	–
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	914	14.705	15.619	–
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G)	115.597	91	115.688	–
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) couverte en SGD	20.014	–	20.014	–
Action de capitalisation de Catégorie D	245.387	18.756	264.143	–
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	248.839	7.463	256.302	–
Action de capitalisation de Catégorie E	643.420	11.233	654.653	–
Action de capitalisation de Catégorie I	500	–	500	–
Action de capitalisation de Catégorie X	24.866	398	25.264	–
Asian Dragon Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	122.237	668	43.028	79.877
Action de capitalisation de Catégorie A	6.642.214	1.061.794	2.034.621	5.669.387
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	249.176	41.339	53.600	236.915
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	127.319	984	35.007	93.296
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	838.097	107.313	217.745	727.665
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	379.424	14.200	218.433	175.191
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	8.718.012	1.592.392	2.565.224	7.745.180
Action de capitalisation de Catégorie C	1.621.808	313.938	812.948	1.122.798
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	566.845	4.109	197.702	373.252
Action de capitalisation de Catégorie D	4.501.985	1.009.030	1.659.396	3.851.619
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	297	–	–	297
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	80.461	20.887	33.400	67.948
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	819.558	144.257	170.510	793.305
Action de capitalisation de Catégorie E	1.457.725	121.818	315.393	1.264.150
Action de distribution (A) de Catégorie I	23.589	7	13.562	10.034
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	46.180	–	42.057	4.123
Action de capitalisation de Catégorie I	207.827	482.060	165.218	524.669
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	1.481	–	–	1.481
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	172	–	–	172
Action de capitalisation de Catégorie X	1.649.459	706.903	84.296	2.272.066
Asian Growth Leaders Fund				
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1.036.474	191.055	294.899	932.630
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	407.135	3.624	64.664	346.095
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	824.051	134.295	240.646	717.700
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1.807.258	71.388	417.280	1.461.366
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	13.491.590	1.360.535	4.503.220	10.348.905
Action de distribution (M) de Catégorie D	360.599	469	6.299	354.769
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	476.289	5.495	107.533	374.251
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1.598.179	1.406.285	2.248.257	756.207
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	257.858	–	25.531	232.327
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	17.527.799	2.228.392	7.977.820	11.778.371
Action de capitalisation de Catégorie E	1.178.662	77.023	218.823	1.036.862
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	232.248	–	131.348	100.900
Action de distribution (Q) de Catégorie I	1.828.789	–	1.828.386	403
Action de capitalisation de Catégorie I	5.931.733	196.212	2.283.029	3.844.916
Action de capitalisation de Catégorie S	1.086.602	70.652	141.011	1.016.243
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en CHF	775.564	26.744	77.565	724.743
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	252.563	–	105.742	146.821
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en GBP	173.581	147.646	56.624	264.603
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en SGD	301.426	170.750	120.373	351.803
Action de capitalisation de Catégorie X	205.709	19.639	50.959	174.389

⁽¹⁾ Compartiment dissous au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Asian High Yield Bond Fund				
Action de distribution (Q) de Catégorie A	500	–	–	500
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	2.668.633	1.030.599	891.084	2.808.148
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	3.314.084	1.332.406	900.521	3.745.969
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en GBP	2.544.051	1.125.006	340.316	3.328.741
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	3.247.527	1.127.400	1.375.165	2.999.762
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en SGD	17.818.252	7.152.636	3.814.433	21.156.455
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	2.318.365	362.203	1.025.719	1.654.849
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	74.410.356	30.293.611	28.244.631	76.459.336
Action de capitalisation de Catégorie A	61.104.637	8.168.446	32.726.808	36.546.275
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	584.779	173.149	102.948	654.980
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	9.169.041	2.340.745	10.917.905	591.881
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	133.240	18.136	129.810	21.566
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	9.435	19.145	–	28.580
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1.253.799	73.875	192.222	1.135.452
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1.071.579	204.709	603.353	672.935
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	37.423	27.339	8.340	56.422
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	14.734.760	1.629.510	685.989	15.678.281
Action de capitalisation de Catégorie D	16.479.218	7.841.050	13.254.818	11.065.450
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	7.266.206	1.150.302	6.487.810	1.928.698
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	480.365	2.770	481.096	2.039
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	862.647	157.343	110.527	909.463
Action de capitalisation de Catégorie E	1.042.806	179.684	171.035	1.051.455
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2.042.354	677.510	464.430	2.255.434
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	20.757.706	641.984	11.654.608	9.745.082
Action de capitalisation de Catégorie I	82.612.794	29.867.379	55.046.795	57.433.378
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	6.939.405	17.994.310	10.226.290	14.707.425
Action de capitalisation de Catégorie X	106.420	46.990	65.414	87.996
Asian Multi-Asset Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	500	21.294	9	21.785
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	–	759	–	759
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	–	668	–	668
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	–	359	–	359
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	–	454	–	454
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	–	392	–	392
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	3.900	35.099	9	38.990
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en JPY	–	709	–	709
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1.455	6.995	179	8.271
Action de capitalisation de Catégorie A	8.836	–	–	8.836
Action de capitalisation de Catégorie I	364.108	–	363.608	500
Action de capitalisation de Catégorie X	5.038.631	4.458	4.193	5.038.896
Asian Sustainable Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	500	–	–	500
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	417.725	–	418.225
Action de capitalisation de Catégorie E	454	–	–	454
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	–	–	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	498.000	51	–	498.051
Action de capitalisation de Catégorie ZI	–	1.003	–	1.003

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Asian Tiger Bond Fund				
Action de distribution (D) de Catégorie A	7.300.063	1.022.303	2.043.407	6.278.959
Action de distribution (M) de Catégorie A	16.080.600	943.215	4.017.024	13.006.791
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	2.888.760	87.814	615.596	2.360.978
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	1.362.202	19.967	326.954	1.055.215
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en HKD	31.155.645	2.952.792	5.548.683	28.559.754
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	1.070.792	94.691	303.227	862.256
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CNH	2.712.499	40.038	502.230	2.250.307
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	15.869.724	3.372.456	3.469.340	15.772.840
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	6.881.181	1.870.354	2.111.867	6.639.668
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	4.313.321	1.545.791	1.129.926	4.729.186
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	3.850.884	479.035	1.221.977	3.107.942
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1.256.236	150.567	257.514	1.149.289
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	98.366.048	20.420.264	31.995.786	86.790.526
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	-	358	-	358
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	7.357.079	1.751.244	1.825.230	7.283.093
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	14.424.976	4.106.054	3.872.631	14.658.399
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	17.754.556	4.384.214	6.527.365	15.611.405
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	30.791.887	4.942.222	5.514.828	30.219.281
Action de capitalisation de Catégorie A	11.164.183	1.253.381	3.502.991	8.914.573
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	2.485.459	431.073	1.326.369	1.590.163
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	388	-	-	388
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	6.824.406	1.656.935	2.132.929	6.348.412
Action de distribution (D) de Catégorie C	118.127	959	19.219	99.867
Action de capitalisation de Catégorie C	142.491	25.801	57.389	110.903
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.280.686	257.377	503.854	1.034.209
Action de distribution (M) de Catégorie D	5.363.177	1.117.844	2.229.423	4.251.598
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en HKD	1.170.316	-	-	1.170.316
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en SGD	80.084	-	40.486	39.598
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	7.816.567	2.066.634	1.797.252	8.085.949
Action de capitalisation de Catégorie D	14.946.431	2.898.929	6.518.450	11.326.910
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	2.462.020	609.568	1.156.955	1.914.633
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	4.987.526	619.192	2.203.158	3.403.560
Action de capitalisation de Catégorie E	1.151.225	21.844	216.218	956.851
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2.914.604	221.609	2.064.183	1.072.030
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.138.776	164.492	244.366	1.058.902
Action de Catégorie I de distribution (M)	6.388.488	3.302.861	4.784.258	4.907.091
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	10.668.847	197.980	10.430.768	436.059
Action de capitalisation de Catégorie I	29.059.667	4.037.622	10.372.973	22.724.316
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	22.482.248	1.682.943	11.753.705	12.411.486
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SGD	3.564.269	651.682	440.294	3.775.657
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	8.625.753	440.094	2.435.436	6.630.411
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	44.800	-	44.439	361
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	301.541	44.547	231.194	114.894
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	421	-	-	421
Action de Catégorie X de distribution (M)	10	-	-	10
Action de capitalisation de Catégorie X	1.663.112	10.239	579.717	1.093.634
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	472	-	-	472
Brown To Green Materials Fund⁽²⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	-	4.102	2	4.100
Action de capitalisation de Catégorie AI	-	466	-	466
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	3.420	-	3.420
Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	466	-	466
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	997	-	997
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	1.995.000	-	1.995.000
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	1.997	-	1.997

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
China Bond Fund				
Action de distribution (M) de Catégorie A	28.489.582	1.777.705	6.982.721	23.284.566
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	-	390	-	390
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	-	500	-	500
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	21.355.037	2.605.607	6.556.019	17.404.625
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	26.373.523	864.430	3.168.317	24.069.636
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	6.556.729	1.666.092	1.888.633	6.334.188
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	23.667.654	1.522.713	8.176.052	17.014.315
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	73.938.062	2.426.916	12.376.357	63.988.621
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	92.238.972	4.972.796	35.245.160	61.966.608
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CAD	1.820.958	832.422	858.087	1.795.293
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.296.890	83.343	418.154	1.962.079
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en NZD	2.204.727	32.988	521.586	1.716.129
Action de capitalisation de Catégorie A	24.761.492	2.206.070	11.080.794	15.886.768
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	548	-	-	548
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	-	677	-	677
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	11.002.021	213.676	6.648.134	4.567.563
Action de capitalisation de Catégorie AI	566.752	115.307	249.808	432.251
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	292.719	11.247	64.706	239.260
Action de capitalisation de Catégorie C	3.505	-	1.521	1.984
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.111.085	243.539	1.093.993	1.260.631
Action de distribution (M) de Catégorie D	7.744.920	72.447	1.878.695	5.938.672
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	912.933	-	-	912.933
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	142.874	26.896	49.126	120.644
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	1.105.048	179.385	604.863	679.570
Action de capitalisation de Catégorie D	34.529.218	2.907.642	19.338.265	18.098.595
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	-	677	-	677
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3.263.633	127.387	2.890.395	500.625
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	2.979.169	261.067	2.309.035	931.201
Action de distribution (Q) de Catégorie E	5.246.973	327.438	1.492.317	4.082.094
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	4.400.621	212.393	1.381.135	3.231.879
Action de Catégorie E de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	27.147	3.674	5.564	25.257
Action de capitalisation de Catégorie E	50.976.050	1.587.249	18.582.004	33.981.295
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	21.972.227	422.659	6.055.478	16.339.408
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	385	-	-	385
Action de Catégorie I de distribution (M)	3.439.933	597.852	77.692	3.960.093
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	2.516.488	29	1.005.818	1.510.699
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	16.810.763	1.826.004	3.578.268	15.058.499
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	577.247	648.830	-	1.226.077
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	13.960.358	116.550	4.586.963	9.489.945
Action de capitalisation de Catégorie I	25.651.309	1.964.938	20.448.129	7.168.118
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	4.304.613	3.645.229	3.161.821	4.788.021
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	954.686	462.012	730.019	686.679
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	-	458	-	458
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en USD	-	500	-	500
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	364	-	-	364
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	104.423	-	98.784	5.639
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	323	72.944	-	73.267
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	451	24	-	475
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	389	-	-	389
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	681	-	-	681
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	500	319.527	45.521	274.506
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	16.681	197.801	-	214.482
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	420	-	-	420
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	1.130.694	-	810.265	320.429
Action de Catégorie X de distribution (M)	386.843	17.061	403.404	500
Action de capitalisation de Catégorie X	55.376	5.616	16.930	44.062
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD	427.674	147.472	256.948	318.198

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
China Flexible Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	25.637	5.178	3.979	26.836
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	34.799	22.160	5.256	51.703
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	445	-	-	445
Action de capitalisation de Catégorie D	31.596	4.340	6.636	29.300
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	445	-	-	445
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	116.770	40.057	6.670	150.157
Action de capitalisation de Catégorie E	482.692	95.245	73.392	504.545
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	547.039	289.607	85.781	750.865
Action de capitalisation de Catégorie I	500	-	-	500
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	445	-	-	445
Action de capitalisation de Catégorie X	1.506.435	9.974	8.388	1.508.021
Action de capitalisation de Catégorie Z	500	-	-	500
China Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	164.577	36.738	27.606	173.709
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	151.116	54.394	96.722
Action de capitalisation de Catégorie A	35.743.471	19.757.187	18.010.351	37.490.307
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	4.195.568	1.254.869	1.218.160	4.232.277
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1.837.698	803.558	434.142	2.207.114
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1.284.403	1.667.655	1.267.135	1.684.923
Action de Catégorie A de capitalisation en HKD	14.195.773	2.523.994	3.877.561	12.842.206
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1.525.006	709.181	516.166	1.718.021
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	445	35.530	35.520	455
Action de capitalisation de Catégorie C	778.366	185.397	203.141	760.622
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	7.975	20.572	11.883	16.664
Action de capitalisation de Catégorie D	9.943.117	2.059.912	1.949.130	10.053.899
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	659.019	505.594	192.160	972.453
Action de Catégorie D de capitalisation en HKD	474	-	-	474
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	642	-	-	642
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.250.676	503.281	519.612	2.234.345
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2.375.621	572.097	480.896	2.466.822
Action de capitalisation de Catégorie I	5.514.671	723.507	1.547.690	4.690.488
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	445	-	-	445
Action de capitalisation de Catégorie X	67.767	35.665	28.927	74.505
China Impact Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	1.267.435	101.673	90.493	1.278.615
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	450	-	-	450
Action de capitalisation de Catégorie D	66.550	-	51.550	15.000
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	6.381	-	-	6.381
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	329.931	195.173	112.913	412.191
Action de capitalisation de Catégorie I	18.600	-	14.000	4.600
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	450	-	-	450
Action de capitalisation de Catégorie X	1.001.195	161.434	1.487	1.161.142
China Innovation Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	500	29.028	9.009	20.519
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	318	3.887	-	4.205
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	19.742	20.780	16.800	23.722
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	318	-	-	318
Action de capitalisation de Catégorie E	474	2.460	-	2.934
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.996.500	2.820	1.200	1.997.500
China Multi-Asset Fund⁽²⁾				
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	500	-	500
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	-	362	-	362
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	-	391	-	391
Action de capitalisation de Catégorie A	-	500	-	500
Action de capitalisation de Catégorie I	-	500	-	500
Action de capitalisation de Catégorie X	-	1.997.500	-	1.997.500

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
China Onshore Bond Fund⁽²⁾				
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	–	121.490	12.185	109.305
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	–	113.032	41.663	71.369
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	50.468	5.823	44.645
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	603	–	603
Action de capitalisation de Catégorie E	–	472	–	472
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	–	472	–	472
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	–	472	–	472
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	347	–	347
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	1.575.990	141.000	1.434.990
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	–	10.014.554	2.183.193	7.831.361
Action de Catégorie ZI de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	–	500	–	500
Action de capitalisation de Catégorie ZI	–	361	–	361
Circular Economy Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	48.250	–	–	48.250
Action de Catégorie A de distribution (T)	–	500	–	500
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	–	747	–	747
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	–	343	–	343
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	–	393	–	393
Action de capitalisation de Catégorie A	9.761.556	1.071.266	2.011.807	8.821.015
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	111.608	45.020	79.150	77.478
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	14.134	410.718	319.746	105.106
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	20.464	103.872	108.408	15.928
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	149.157	208.943	79.639	278.461
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	53.216	25.254	14.263	64.207
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	352.000	12.573	135.907	228.666
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	15.292	–	2.162	13.130
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	78.195	3.244	11.409	70.030
Action de capitalisation de Catégorie AI	3.901.594	840.639	1.288.175	3.454.058
Action de capitalisation de Catégorie C	–	445	–	445
Action de capitalisation de Catégorie D	5.474.505	2.055.642	2.770.505	4.759.642
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.154.806	95.335	681.208	568.933
Action de capitalisation de Catégorie E	30.529.567	3.951.976	4.443.569	30.037.974
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	144.043	582.976	83.423	643.596
Action de capitalisation de Catégorie I	70.785.858	7.747.275	19.341.308	59.191.825
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	42.362.064	176.784	12.576.529	29.962.319
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	266.518	–	183.460	83.058
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.642.558	167.110	300.246	1.509.422
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	22.363	–	–	22.363
Action de capitalisation de Catégorie X	2.015.505	1.389.892	1.521.810	1.883.587
Action de capitalisation de Catégorie Z	500	–	–	500
Climate Action Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	1.001	3.799	40	4.760
Action de capitalisation de Catégorie AI	443	–	–	443
Action de capitalisation de Catégorie C	456	1.376	–	1.832
Action de capitalisation de Catégorie D	1.499	11.095	477	12.117
Action de capitalisation de Catégorie E	3.120	19.698	6.684	16.134
Action de capitalisation de Catégorie I	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie X	496.000	–	–	496.000
Climate Action Multi-Asset Fund				
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	564	–	–	564
Action de capitalisation de Catégorie A	500	14.791	791	14.500
Action de capitalisation de Catégorie AI	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie C	500	948	–	1.448
Action de capitalisation de Catégorie D	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie E	5.415	13.331	534	18.212
Action de capitalisation de Catégorie I	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie X	4.996.500	–	–	4.996.500

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Continental European Flexible Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	2.439.012	336.347	500.919	2.274.440
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.246.997	93.841	177.292	1.163.546
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	416.056	37.437	61.890	391.603
Action de capitalisation de Catégorie A	4.509.623	338.473	1.444.641	3.403.455
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	15.990.535	840.459	5.119.207	11.711.787
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	28.509.580	3.812.478	7.939.084	24.382.974
Action de capitalisation de Catégorie AI	196.751	12.176	41.679	167.248
Action de capitalisation de Catégorie C	2.844.134	275.034	342.023	2.777.145
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	11.063.281	2.609.162	4.020.773	9.651.670
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.678.100	282.704	563.164	2.397.640
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	237.653	24.996	85.542	177.107
Action de capitalisation de Catégorie D	26.087.445	6.289.674	10.030.891	22.346.228
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	4.303.814	457.906	1.602.922	3.158.798
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.427.671	226.050	480.693	1.173.028
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.753.358	161.624	678.017	1.236.965
Action de capitalisation de Catégorie E	9.545.393	1.032.406	1.857.557	8.720.242
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	15.911.227	4.058.917	6.921.435	13.048.709
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	11.870	21.850	1.716	32.004
Action de capitalisation de Catégorie I	27.987.271	15.240.989	13.469.991	29.758.269
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	1.932.972	976.247	676.445	2.232.774
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	206.559	273.176	95.797	383.938
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	12.574.410	3.922.410	8.048.042	8.448.778
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	286.421	637.778	308.062	616.137
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	728.256	-	728.167	89
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	7.618.032	1.138.815	2.082.827	6.674.020
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	1.044.701	167.980	803.129	409.552
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	186.229	62.207	104.265	144.171
Action de capitalisation de Catégorie X	693.284	1.913.848	627.678	1.979.454
Developed Markets Sustainable Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	995	-	-	995
Action de capitalisation de Catégorie D	464	-	-	464
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie E	427	247	-	674
Action de capitalisation de Catégorie I	464	-	-	464
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	724.214	49.690	283.530	490.374
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	498.000	1.092.864	310.881	1.279.983
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	1.003	-	1.003

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Dynamic High Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	27.129.393	8.066.145	8.527.356	26.668.182
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	6.701.553	3.590.589	3.431.111	6.861.031
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	518	21	-	539
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	2.450.741	1.453.297	768.952	3.135.086
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	200.779.402	32.745.202	48.675.880	184.848.724
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	3.032.995	3.172.999	1.965.417	4.240.577
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	35.578.174	7.511.020	8.098.078	34.991.116
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	15.485.494	3.442.303	3.476.259	15.451.538
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	28.284.119	11.477.384	12.731.426	27.030.077
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	61.749.318	4.933.220	8.446.435	58.236.103
Action de capitalisation de Catégorie A	14.702.012	522.664	5.063.689	10.160.987
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	28.602	11.769	17.637	22.734
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1.275.842	32.584	286.064	1.022.362
Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	35.746	308	18.565	17.489
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	16.607	2.573	3.212	15.968
Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	147.645	5.475	84.584	68.536
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	8.872.688	578.531	924.938	8.526.281
Action de capitalisation de Catégorie D	935.796	269.670	461.980	743.486
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	485	-	-	485
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	134.939	-	78.096	56.843
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	694.797	119.725	150.310	664.212
Action de capitalisation de Catégorie E	142.993	21.132	37.198	126.927
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	607.713	15.317	123.568	499.462
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	1.635.030	94.362	606.786	1.122.606
Action de capitalisation de Catégorie I	500	-	-	500
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	1.246.774	1.824	612.212	636.386
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	87.764	-	32.483	55.281
Action de capitalisation de Catégorie X	3.470.004	382.077	547.642	3.304.439
Emerging Europe Fund⁽³⁾				
Action de distribution (A) de Catégorie A	41.415	-	-	41.415
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	7.206	-	-	7.206
Action de capitalisation de Catégorie A	4.248.968	-	-	4.248.968
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	94.143	-	-	94.143
Action de capitalisation de Catégorie C	64.429	-	-	64.429
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.885	-	-	2.885
Action de capitalisation de Catégorie D	340.629	-	-	340.629
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.496	-	-	1.496
Action de capitalisation de Catégorie E	199.797	-	-	199.797
Action de capitalisation de Catégorie I	841.082	-	-	841.082
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	40	-	-	40
Action de capitalisation de Catégorie X	11	-	-	11

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Emerging Markets Bond Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	6.263.092	11.019	778.163	5.495.948
Action de distribution (D) de Catégorie A	653.392	39.574	94.989	597.977
Action de distribution (M) de Catégorie A	2.283.089	723.548	580.270	2.426.367
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1.340.433	679.324	711.967	1.307.790
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	312.882	348.245	341.306	319.821
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	183.486	79.178	73.557	189.107
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	345	13	-	358
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	8.186.749	1.889.119	1.996.634	8.079.234
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	694.900	69.926	82.401	682.425
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	846.518	229.229	358.892	716.855
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	2.818.615	437.969	392.731	2.863.853
Action de capitalisation de Catégorie A	4.689.414	4.755.884	4.707.535	4.737.763
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	6.122.703	53.391	1.497.281	4.678.813
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1.275.921	3.218	101.011	1.178.128
Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	23.826	3.346	12.442	14.730
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	18.460	1.015	851	18.624
Action de distribution (D) de Catégorie C	103.811	2.103	12.651	93.263
Action de capitalisation de Catégorie C	1.224.614	12.348	185.052	1.051.910
Action de distribution (M) de Catégorie D	781.722	790.712	21.352	1.551.082
Action de capitalisation de Catégorie D	211.497	34.692	107.860	138.329
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	2.832.099	2.019.897	1.619.733	3.232.263
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.271.820	1.310.352	700.379	1.881.793
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	559.261	38.382	41.263	556.380
Action de capitalisation de Catégorie E	3.319.684	142.214	626.591	2.835.307
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	906.212	127.776	253.831	780.157
Action de distribution (A) de Catégorie I	77.069	18.448	7.100	88.417
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	483	26	-	509
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	388	-	-	388
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	294.047	17.943	280.139	31.851
Action de capitalisation de Catégorie I	13.172.377	3.920.576	2.527.740	14.565.213
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1.255.550	5.112.970	154.689	6.213.831
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	492	-	-	492
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	350	-	-	350
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en CHF	1.469.005	85.749	-	1.554.754
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en EUR	540	31	-	571
Action de capitalisation de Catégorie X	3.021.903	749.770	2.564.262	1.207.411
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	7.459.196	794.941	2.258.582	5.995.555
Emerging Markets Corporate Bond Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	6.285.166	1.328.716	2.811.857	4.802.025
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	131.748	27.254	40.982	118.020
Action de capitalisation de Catégorie AI	440	6.936	6.936	440
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	63.835	24.162	10.798	77.199
Action de capitalisation de Catégorie D	4.109.737	733.471	1.551.388	3.291.820
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	102.725	707.270	618.705	191.290
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	291.517	47.879	26.850	312.546
Action de capitalisation de Catégorie E	935.850	190.615	215.666	910.799
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	554.192	41.041	28.569	566.664
Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	10.804.217	492.748	16.072	11.280.893
Action de Catégorie I de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	310	-	310	-
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	5.005.446	23	2.605.006	2.400.463
Action de capitalisation de Catégorie I	6.058.182	978.087	1.158.662	5.877.607
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	491	-	-	491
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	3.939.343	1.335.226	1.956.244	3.318.325
Action de Catégorie SR de distribution (M)	-	500	-	500
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	364	-	-	364
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	677.095	225.308	219.590	682.813
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	23.703	-	-	23.703
Action de capitalisation de Catégorie X	20.933.541	2.572.683	1.792.792	21.713.432
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY	14.836.034	18.339	805.085	14.049.288

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Emerging Markets Equity Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	410.473	7.173	43.130	374.516
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	151.886	97.676	114.877	134.685
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	507	53	73	487
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	19.919	148.136	133.205	34.850
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1.146.242	1.229.298	1.262.523	1.113.017
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	24.756	41.146	547	65.355
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	112.152	56.735	35.918	132.969
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	197.485	246.935	250.234	194.186
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	238.621	148.765	153.629	233.757
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	108.498	28.718	28.495	108.721
Action de capitalisation de Catégorie A	1.555.601	387.340	556.629	1.386.312
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	484	58.818	4.471	54.831
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	497	4.392	4.373	516
Action de capitalisation de Catégorie AI	448	-	-	448
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	544.037	112.307	154.078	502.266
Action de capitalisation de Catégorie D	1.725	-	-	1.725
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	7.596	-	7.141	455
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	5.922.063	790.783	1.787.800	4.925.046
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	416.443	42.322	12.951	445.814
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	384.095	65.834	47.708	402.221
Action de capitalisation de Catégorie I	733.205	-	-	733.205
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	621	-	-	621
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	90	3	78	15
Action de capitalisation de Catégorie X	9.665.197	-	7.150.823	2.514.374
Emerging Markets Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	52.164	17.270	2.058	67.376
Action de capitalisation de Catégorie A	11.144.696	2.026.462	2.178.641	10.992.517
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	72.409	98.483	10.829	160.063
Action de capitalisation de Catégorie AI	112.236	30.255	55.367	87.124
Action de capitalisation de Catégorie C	887.431	97.201	158.160	826.472
Action de capitalisation de Catégorie D	5.603.383	2.631.416	2.136.012	6.098.787
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	116.690	124.588	92.128	149.150
Action de capitalisation de Catégorie E	2.301.011	423.411	464.086	2.260.336
Action de distribution (A) de Catégorie I	2.196.879	2	411	2.196.470
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	13.357.564	510.189	634.176	13.233.577
Action de capitalisation de Catégorie I	38.094.548	40.621.652	30.627.469	48.088.731
Action de capitalisation de Catégorie SI	50.869.424	10.635.178	-	61.504.602
Action de capitalisation de Catégorie X	30.309.001	3.459.010	7.860.773	25.907.238
Emerging Markets Impact Bond Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	500	-	-	500
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	37.853	-	38.353
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	6.690	362.440	368.705	425
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	425	216	-	641
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	267.900	-	268.400
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	6.729.025	1.393.845	11.900	8.110.970
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	952.993	5.687	955.375	3.305
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	500	-	-	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.997.000	-	466.200	1.530.800
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	500	-	500

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Emerging Markets Local Currency Bond Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	66.992	3.434	23.521	46.905
Action de distribution (D) de Catégorie A	1.556.927	24.933	113.268	1.468.592
Action de distribution (M) de Catégorie A	7.099.506	813.510	1.567.265	6.345.751
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	68.007	-	-	68.007
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	470.004	882	38.044	432.842
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	36.093	-	-	36.093
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	2.913.157	79.570	366.029	2.626.698
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	94.900	509	-	95.409
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	348.818	30.488	18.892	360.414
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	299.445	-	104.056	195.389
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1.024.762	104.644	203.976	925.430
Action de capitalisation de Catégorie A	7.478.586	4.389.062	1.872.444	9.995.204
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	124.452	-	31.523	92.929
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	974.355	33.480.624	15.899.082	18.555.897
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	992.266	696.038	838.757	849.547
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	430	-	-	430
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	200.820	2.615.266	1.343.401	1.472.685
Action de Catégorie AI de distribution (Q)	516	3.644	-	4.160
Action de capitalisation de Catégorie AI	440	-	-	440
Action de distribution (D) de Catégorie C	126.061	111	-	126.172
Action de capitalisation de Catégorie C	256.260	56.217	144.069	168.408
Action de distribution (A) de Catégorie D	76.127	3.866	8.077	71.916
Action de distribution (M) de Catégorie D	231.724	1.990	86.789	146.925
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en AUD	512	-	-	512
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	546.412	61.748	319.334	288.826
Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	4.789	-	-	4.789
Action de capitalisation de Catégorie D	3.432.030	2.428.549	2.837.835	3.022.744
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	56.290	-	-	56.290
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	2.920.140	2.840.930	1.897.084	3.863.986
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	52.040	-	-	52.040
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	641	-	-	641
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	60.504	28.031	23.140	65.395
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	232.681	34.925	16.084	251.522
Action de capitalisation de Catégorie E	805.381	84.323	130.219	759.485
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	476.242	119.567	79.698	516.111
Action de Catégorie I de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	9	-	9	-
Action de distribution (Q) de Catégorie I	5.469.222	1.789.163	2.749.886	4.508.499
Action de capitalisation de Catégorie I	32.509.117	8.185.959	11.025.753	29.669.323
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	3.618.056	6.528.773	2.487.301	7.659.528
Action de distribution (M) de Catégorie S	-	461	-	461
Action de Catégorie S de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	390	-	390	-
Action de capitalisation de Catégorie S	-	999	-	999
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	-	458	-	458
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	360	-	-	360
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	171.720	26.624	73.369	124.975
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	415	-	-	415
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en GBP	380	-	-	380
Action de capitalisation de Catégorie X	17.722.251	8.042.735	752.863	25.012.123
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	16.946.407	-	14.451.420	2.494.987

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Emerging Markets Sustainable Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	993	285	–	1.278
Action de capitalisation de Catégorie D	517	106.916	6.248	101.185
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie E	1.263	5.755	2.655	4.363
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	993	1.056.725	–	1.057.718
Action de capitalisation de Catégorie X	652	1.259	–	1.911
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	765	–	–	765
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	7.575.483	2.370.956	973.514	8.972.925
Action de capitalisation de Catégorie ZI	–	1.003	–	1.003
ESG Flex Choice Cautious Fund				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	48.195	–	16.177	32.018
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	1.897	35.171	35.118	1.950
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	644	–	–	644
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	319	–	–	319
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	412	–	–	412
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	3.598	–	–	3.598
Action de Catégorie A de distribution (T)	196.207	84.001	116.935	163.273
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	13.766	–	–	13.766
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	641	–	–	641
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	4.245	9.562	–	13.807
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	411	–	–	411
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	8.701	571	2.363	6.909
Action de capitalisation de Catégorie A	542.470	2.364.111	2.607.454	299.127
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	682	–	–	682
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	644	–	–	644
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	13.261	59.470	25.362	47.369
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	412	–	–	412
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	389	–	–	389
Action de capitalisation de Catégorie D	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie I	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie X	492.789	–	–	492.789
ESG Flex Choice Growth Fund				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	33.036	25.564	34.444	24.156
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	20.943	9.236	20.247	9.932
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	644	–	–	644
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	7.611	–	6.699	912
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	411	–	–	411
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	4.374	8.136	12.121	389
Action de Catégorie A de distribution (T)	316.639	182.739	208.554	290.824
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	361.490	–	247.862	113.628
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	641	–	–	641
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	28.657	27.606	14.646	41.617
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	411	5.835	–	6.246
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	326.067	27.088	132.917	220.238
Action de capitalisation de Catégorie A	40.543	98.085	39.521	99.107
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	15.489	2.686	1.242	16.933
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	644	–	–	644
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	11.254	12.311	14.837	8.728
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	412	–	–	412
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	12.473	5.218	5.885	11.806
Action de capitalisation de Catégorie D	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie I	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie X	492.702	–	–	492.702

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
ESG Flex Choice Moderate Fund				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	71.210	7.144	70.072	8.282
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	63.718	5.775	57.907	11.586
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	644	-	-	644
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	3.175	-	2.856	319
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	411	20.902	-	21.313
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	2.428	-	-	2.428
Action de Catégorie A de distribution (T)	311.651	161.336	162.137	310.850
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	138.780	482	126.139	13.123
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	641	-	-	641
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	53.514	34.570	50.025	38.059
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	411	-	-	411
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	342.879	36.456	181.165	198.170
Action de capitalisation de Catégorie A	24.712	633.549	371.406	286.855
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	682	-	-	682
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	644	-	-	644
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	16.017	12.967	13.770	15.214
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	412	-	-	412
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	12.625	-	12.236	389
Action de capitalisation de Catégorie D	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie I	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie X	492.731	-	-	492.731
ESG Global Conservative Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	81.809	4.191	2.880	83.120
Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G)	119.751	2.365	30.132	91.984
Action de capitalisation de Catégorie A	786	-	-	786
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G)	18.940.093	2.040.490	9.900.950	11.079.633
Action de capitalisation de Catégorie AI	8.030.537	734.252	4.740.971	4.023.818
Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	558	22	-	580
Action de Catégorie D de distribution (Y) (Q) (G)	492	22	514	-
Action de capitalisation de Catégorie D	26.371	5.882	31.753	500
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	33.534.388	2.068.997	13.375.365	22.228.020
Action de Catégorie E de distribution (S) (M) (G)	290.693	14.670	67.001	238.362
Action de Catégorie E de distribution (Y) (Q) (G)	279.121	56.827	17.756	318.192
Action de capitalisation de Catégorie E	7.713.147	442.980	2.848.414	5.307.713
Action de Catégorie I de distribution (Y) (Q) (G)	493	22	515	-
Action de capitalisation de Catégorie I	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie X	1.975.585	-	1.975.107	478
ESG Global Multi-Asset Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	454	23	-	477
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	500	-	-	500
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	454	486.509	261.382	225.581
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	389	-	-	389
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	673	1.141	1.141	673
Action de capitalisation de Catégorie A	1.492	227	15	1.704
Action de capitalisation de Catégorie D	500	-	-	500
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	452	23	-	475
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	444	2.974	-	3.418
Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) couverte en GBP	10.673.442	321.787	-	10.995.229
Action de capitalisation de Catégorie X	4.995.000	-	414.847	4.580.153

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
ESG Multi-Asset Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	112.069.822	24.386.267	26.980.386	109.475.703
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en SGD	3.344.410	611.898	976.479	2.979.829
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	5.120.680	744.419	1.948.056	3.917.043
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	318	4.443	–	4.761
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en SGD	31.656	124.840	58.965	97.531
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en USD	55.974	454.271	277.802	232.443
Action de capitalisation de Catégorie A	44.074.038	14.717.920	15.544.057	43.247.901
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	874.230	463.913	494.314	843.829
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	843.420	365.508	310.717	898.211
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	4.623.445	1.597.084	1.973.122	4.247.407
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en ZAR	365.347	346.895	353.703	358.539
Action de capitalisation de Catégorie AI	23.992.237	2.578.092	8.417.504	18.152.825
Action de capitalisation de Catégorie C	63.674.543	9.243.482	10.804.395	62.113.630
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en USD	581.628	139.617	211.212	510.033
Action de capitalisation de Catégorie D	30.587.379	19.486.229	34.504.686	15.568.922
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	2.311.262	311.829	173.742	2.449.349
Action de capitalisation de Catégorie E	102.855.416	12.911.427	20.387.814	95.379.029
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en USD	2.582.985	588.531	729.200	2.442.316
Action de capitalisation de Catégorie I	30.162.033	34.663.006	16.135.338	48.689.701
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	44.154	349	8.678	35.825
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	1.811.328	12.830.982	1.221.302	13.421.008
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	500	–	–	500
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	425	–	–	425
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	425	–	–	425
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2.607	4.132	1.076	5.663
Action de capitalisation de Catégorie I	500	577.367	–	577.867
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	665	–	–	665
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	420	660.779	–	661.199
Action de capitalisation de Catégorie X	500	–	–	500
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	13.931.092	1.740.755	2.719.018	12.952.829
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	420	871.492	45.799	826.113

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Euro Bond Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	3.094.421	190.205	395.461	2.889.165
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	4.672	687	659	4.700
Action de distribution (D) de Catégorie A	407.063	50.373	186.800	270.636
Action de distribution (M) de Catégorie A	175.073	46.744	47.487	174.330
Action de capitalisation de Catégorie A	15.812.901	4.932.621	6.758.494	13.987.028
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	548	16.800	–	17.348
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	49.340	9.904	48.237	11.007
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	250.577	192.924	332.986	110.515
Action de capitalisation de Catégorie AI	19.184	42.604	8.634	53.154
Action de capitalisation de Catégorie C	312.093	70.176	66.343	315.926
Action de distribution (A) de Catégorie D	1.160.851	35.627	437.375	759.103
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	8.166	1.821	2.540	7.447
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	20.601	5	5	20.601
Action de distribution (M) de Catégorie D	103.765	1.633	24.283	81.115
Action de capitalisation de Catégorie D	13.166.241	3.519.672	6.954.816	9.731.097
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	190.407	15.931	3.202	203.136
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	871.569	502.618	936.836	437.351
Action de distribution (Q) de Catégorie E	1.380.330	71.155	169.913	1.281.572
Action de capitalisation de Catégorie E	2.723.160	1.023.380	547.663	3.198.877
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	631.021	389.247	798.765	221.503
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.005.261	266.451	2.271.365	347
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	1.692.643	260.591	1.952.734	500
Action de capitalisation de Catégorie I	116.340.142	41.369.574	87.366.304	70.343.412
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	43.694	65.034	90.714	18.014
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	548	–	–	548
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	40.569.383	4.292.952	44.051.631	810.704
Action de Catégorie S de distribution (A)	734.494	5.602	41.598	698.498
Action de distribution (M) de Catégorie S	–	457	–	457
Action de capitalisation de Catégorie S	–	913	–	913
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	84.739	658.729	84.324	659.144
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	38.343	–	7.911	30.432
Action de capitalisation de Catégorie X	5.265.156	1.018.173	312.471	5.970.858
Euro Corporate Bond Fund				
Action de distribution (D) de Catégorie A	383.246	119.696	69.939	433.003
Action de distribution (M) de Catégorie A	348.026	110.038	107.515	350.549
Action de capitalisation de Catégorie A	6.376.409	11.681.188	4.999.199	13.058.398
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	74.738	6.251	23.524	57.465
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	26.841	3.956	9.000	21.797
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	8.190.322	9.787.010	17.856.903	120.429
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	137.230	472.616	472.163	137.683
Action de capitalisation de Catégorie AI	99.259	132.381	29.834	201.806
Action de capitalisation de Catégorie C	430.506	181.337	82.132	529.711
Action de distribution (M) de Catégorie D	1.963.735	894.491	1.019.614	1.838.612
Action de capitalisation de Catégorie D	23.535.930	21.175.856	12.879.936	31.831.850
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	37.195	245.800	13.600	269.395
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	51.225	–	41.900	9.325
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	536.525	244.544	46.634	734.435
Action de distribution (Q) de Catégorie E	3.154.638	471.481	330.582	3.295.537
Action de capitalisation de Catégorie E	3.646.963	4.356.737	835.540	7.168.160
Action de distribution (Q) de Catégorie I	5.121.713	467.983	2.850.828	2.738.868
Action de capitalisation de Catégorie I	109.272.928	79.999.526	63.018.765	126.253.689
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	495	–	–	495
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	27.820	703	28.143	380
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	5.066.349	–	2.320	5.064.029
Action de Catégorie X de distribution (Q)	27.285.994	5.512.689	7.776.610	25.022.073
Action de capitalisation de Catégorie X	24.134.827	1.854.008	10.194.050	15.794.785

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Euro Reserve Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	643.026	638.228	661.540	619.714
Action de capitalisation de Catégorie C	498.130	811.351	548.753	760.728
Action de capitalisation de Catégorie D	93.518	76.386	82.985	86.919
Action de capitalisation de Catégorie E	508.206	291.734	338.494	461.446
Action de capitalisation de Catégorie X	44.222	16.728	14.743	46.207
Euro Short Duration Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.078.143	133.608	991.428	1.220.323
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	584.609	39.177	65.314	558.472
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	71.635	26.916	34.820	63.731
Action de distribution (D) de Catégorie A	1.025.984	757.495	780.153	1.003.326
Action de distribution (M) de Catégorie A	79.557	193.290	13.658	259.189
Action de capitalisation de Catégorie A	64.816.316	22.725.520	25.678.888	61.862.948
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	637.334	412.137	364.703	684.768
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	4.590.692	237.510	821.346	4.006.856
Action de capitalisation de Catégorie AI	218.540	374.083	226.035	366.588
Action de capitalisation de Catégorie C	946.809	193.324	222.516	917.617
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.800.592	195.567	789.481	1.206.678
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	535.358	54.332	226.127	363.563
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	144.654	4.500	33.336	115.818
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	324.998	632.062	185.258	771.802
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	79.197	66.532	49.431	96.298
Action de capitalisation de Catégorie D	41.738.223	44.614.253	33.544.882	52.807.594
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1.283.351	762.954	682.707	1.363.598
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	248.903	52.172	93.866	207.209
Action de capitalisation de Catégorie E	15.241.951	2.598.916	3.624.278	14.216.589
Action de distribution (Q) de Catégorie I	391.900	3	318.368	73.535
Action de capitalisation de Catégorie I	84.377.341	28.182.872	43.693.387	68.866.826
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	111.771	-	79.397	32.374
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	454.232	125.188	253.766	325.654
Action de Catégorie S de distribution (A)	-	460	-	460
Action de distribution (M) de Catégorie S	-	447	-	447
Action de capitalisation de Catégorie S	-	3.081.167	-	3.081.167
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en USD	-	500	-	500
Action de capitalisation de Catégorie SI	166.748.613	30.825.290	84.935.671	112.638.232
Action de Catégorie SI de capitalisation couverte en USD	57.321	15.224	67.253	5.292
Action de capitalisation de Catégorie X	27.745.488	3.079.532	7.646.233	23.178.787
Euro-Markets Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	2.999.503	61.127	236.975	2.823.655
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	9.976	9.237	13.041	6.172
Action de capitalisation de Catégorie A	15.882.891	4.795.493	5.085.245	15.593.139
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	266.299	2.705	33.645	235.359
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	157.236	13.249	19.792	150.693
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	31.814	-	347	31.467
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	36.712	276	12.625	24.363
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	2.346.923	109.816	834.474	1.622.265
Action de capitalisation de Catégorie AI	62.850	8.744	47.968	23.626
Action de capitalisation de Catégorie C	396.286	64.592	147.194	313.684
Action de distribution (A) de Catégorie D	61.259	325	16.712	44.872
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	139.189	4.041	14.347	128.883
Action de capitalisation de Catégorie D	79.682	363.683	371.873	71.492
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	809.875	137.896	483.515	464.256
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	5.969.142	750.547	1.544.086	5.175.603
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	516.094	192.979	171.242	537.831
Action de capitalisation de Catégorie E	2.986.918	188.930	536.096	2.639.752
Action de distribution (A) de Catégorie I	97.104	1.654	24.854	73.904
Action de capitalisation de Catégorie I	7.223.318	740.190	5.372.694	2.590.814
Action de Catégorie S de distribution (A)	35.540	2.169	6.235	31.474
Action de capitalisation de Catégorie S	129.083	10.846	34.010	105.919
Action de capitalisation de Catégorie X	5	1.243.150	530	1.242.625

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
European Equity Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	18.648.670	1.067.562	1.780.546	17.935.686
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	2.851.567	426.893	552.468	2.725.992
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en USD	735.710	122.696	194.655	663.751
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	5.028.905	1.121.761	1.518.750	4.631.916
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	699.238	168.058	137.982	729.314
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	131.550	97.059	144.535	84.074
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	993.656	85.619	138.840	940.435
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	467.205	157.009	373.743	250.471
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	11.829.419	995.614	2.513.345	10.311.688
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	980.188	117.392	357.916	739.664
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	2.377.642	417.031	590.726	2.203.947
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	17.848.061	868.284	7.359.942	11.356.403
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	12.426.392	703.070	3.936.305	9.193.157
Action de capitalisation de Catégorie A	6.449.693	879.504	1.557.081	5.772.116
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	3.329.851	300.323	1.570.961	2.059.213
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	299.304	51.762	80.477	270.589
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G)	473.047	243.292	231.208	485.131
Action de capitalisation de Catégorie AI	375.213	243.618	179.445	439.386
Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	4.100.609	494.797	1.199.427	3.395.979
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	21.899	80	12.414	9.565
Action de Catégorie D de distribution (M) (G)	-	4.059.746	986.100	3.073.646
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.445.877	499.417	789.164	1.156.130
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.122.014	299.031	284.735	1.136.310
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	80.799	48.576	29.116	100.259
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	1.420.555	25.801	702.608	743.748
Action de capitalisation de Catégorie D	4.338.612	1.331.916	1.421.852	4.248.676
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	37.039	17	33.903	3.153
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	1.924.057	91.645	1.636.043	379.659
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	8.855.892	894.820	1.342.931	8.407.781
Action de capitalisation de Catégorie E	4.545.498	489.468	750.548	4.284.418
Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	2.832.567	-	2.465.379	367.188
Action de capitalisation de Catégorie I	10.244.560	650.445	5.226.056	5.668.949
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	632.511	-	-	632.511
Action de Catégorie SR de distribution (A) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	55.640	22.723	36.316	42.047
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	283.077	382.118	107.945	557.250
Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	4.831.559	1.135.547	1.112.361	4.854.745
Action de capitalisation de Catégorie X	7.633	2.954	646	9.941
European Focus Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	3.155.341	214.464	701.937	2.667.868
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	392	4	4	392
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	313.226	2.632	49.189	266.669
Action de capitalisation de Catégorie AI	164.347	151.889	45.678	270.558
Action de capitalisation de Catégorie C	459.671	101.482	66.626	494.527
Action de capitalisation de Catégorie D	303.014	29.560	165.647	166.927
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.195.652	193.334	395.824	1.993.162
Action de capitalisation de Catégorie E	4.734.178	330.504	694.517	4.370.165
Action de capitalisation de Catégorie I	26.434	10.785	2.061	35.158

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
European Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	34.414	4.790	3.481	35.723
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	3.007	350	1.479	1.878
Action de capitalisation de Catégorie A	2.895.006	492.784	1.025.663	2.362.127
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	205.765	44.740	52.908	197.597
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	107.308	2.308	53.251	56.365
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	4.678	6.944	832	10.790
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	170.745	26.311	39.689	157.367
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	5.145.657	124.043	1.862.674	3.407.026
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	80.149	5.596	27.432	58.313
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	570.410	771.993	151.651	1.190.752
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	3.261.973	314.541	1.006.069	2.570.445
Action de capitalisation de Catégorie C	215.942	13.529	44.730	184.741
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	6.730	1.489	485	7.734
Action de capitalisation de Catégorie D	157.856	64.474	70.650	151.680
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	234.005	36.031	140.213	129.823
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	783.774	656.403	420.488	1.019.689
Action de capitalisation de Catégorie E	507.462	39.143	77.617	468.988
Action de capitalisation de Catégorie I	587.551	415.567	381.159	621.959
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	8.261	258.656	165.238	101.679
Action de capitalisation de Catégorie S	1.655.358	2.051.428	318.615	3.388.171
Action de capitalisation de Catégorie X	1.654.304	380.942	610.773	1.424.473
European High Yield Bond Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	1.544.200	4.664.596	2.013.002	4.195.794
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	118.953	44.332	34.406	128.879
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1.530	87.962	21.467	68.025
Action de distribution (A) de Catégorie D	6.880.052	61.386	4.908.486	2.032.952
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	34.089	40.869	9.596	65.362
Action de capitalisation de Catégorie D	4.924.366	4.043.306	2.629.029	6.338.643
Action de distribution (Q) de Catégorie E	1.918.566	265.597	141.323	2.042.840
Action de capitalisation de Catégorie E	3.912.840	2.376.018	891.963	5.396.895
Action de capitalisation de Catégorie X	431.638	159.815	185.996	405.457
Action de capitalisation de Catégorie Z	10.000.341	3.544.384	5.266.831	8.277.894
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en USD	344.220	-	-	344.220
European Special Situations Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	216.295	78.112	21.421	272.986
Action de capitalisation de Catégorie A	9.281.550	1.258.532	2.491.716	8.048.366
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	111.358	16.114	39.670	87.802
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	28.052	32.156	44.994	15.214
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	115	581	-	696
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	83.030	26.423	23.771	85.682
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	82.640	111.612	108.039	86.213
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	6.677.795	636.092	953.750	6.360.137
Action de capitalisation de Catégorie C	297.082	22.347	29.759	289.670
Action de capitalisation de Catégorie D	3.353.535	770.819	505.214	3.619.140
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	553.795	1.821.147	1.325.754	1.049.188
Action de capitalisation de Catégorie E	1.609.361	142.035	288.503	1.462.893
Action de distribution (A) de Catégorie I	462	3	-	465
Action de capitalisation de Catégorie I	13.173.643	2.995.599	2.885.896	13.283.346
Action de capitalisation de Catégorie X	164.806	-	24.558	140.248
European Sustainable Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	679	1.269	773	1.175
Action de capitalisation de Catégorie AI	425	-	-	425
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	17.160	13.527	6.121	24.566
Action de capitalisation de Catégorie E	2.136	32.676	25.658	9.154
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	498.500	-	-	498.500
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	920	-	920

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
European Value Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	191.484	27.867	35.211	184.140
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	8.007	7.252	298	14.961
Action de capitalisation de Catégorie A ⁽⁶⁾	2.641.740	860.034	1.247.937	2.253.837
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	135.651	48.661	116.761	67.551
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	8.778	562	9.012	328
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	194.305	3.661	141.040	56.926
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	2.812.000	445.774	1.279.150	1.978.624
Action de capitalisation de Catégorie C	273.844	106.170	105.047	274.967
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	8.245	2.555	2.758	8.042
Action de capitalisation de Catégorie D	2.190.999	867.795	1.581.735	1.477.059
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	298.200	724.028	490.809	531.419
Action de capitalisation de Catégorie E	1.108.157	235.995	298.990	1.045.162
Action de capitalisation de Catégorie I	8.697.417	3.649.699	6.203.883	6.143.233
Action de Catégorie S de distribution (A)	63.435	15	3.312	60.138
Action de capitalisation de Catégorie X	6.178.292	-	433	6.177.859
FinTech Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	6.700	-	-	6.700
Action de capitalisation de Catégorie A	9.696.383	873.757	4.315.713	6.254.427
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1.140.068	293.954	444.088	989.934
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	834.829	186.499	216.006	805.322
Action de capitalisation de Catégorie AI	308.332	13.476	65.208	256.600
Action de Catégorie C de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.840.322	-	2.439.841	400.481
Action de capitalisation de Catégorie D	909.318	372.145	598.427	683.036
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	307.075	34.863	174.692	167.246
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	5.146.892	268.451	1.878.959	3.536.384
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	776.039	109.282	286.555	598.766
Action de capitalisation de Catégorie E	4.008.459	1.065.359	1.191.815	3.882.003
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	3.205.026	487.170	677.117	3.015.079
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie I	6.257.104	505.766	5.944.276	818.594
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	28.029	-	6.219	21.810
Action de capitalisation de Catégorie X	645.430	248.090	322.296	571.224
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.435.359	4.300	512.614	927.045

⁽⁶⁾ Les actions rachetées comprennent l'annulation des actions non attribuées qui ont été émises lors de la fusion d'ECS – European Basic Value dans European Value Fund (fusion historique du Compartiment en 2002). L'annulation des actions n'a pas eu d'incidence négative sur la VL du Compartiment.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Fixed Income Global Opportunities Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	100.416	123.864	9.675	214.605
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	459.648	31.809	202.430	289.027
Action de distribution (D) de Catégorie A	3.064.097	388.842	612.591	2.840.348
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	-	500	-	500
Action de distribution (M) de Catégorie A	412.129	25.265	162.156	275.238
Action de distribution (Q) de Catégorie A	5.101.838	285.019	981.986	4.404.871
Action de Catégorie A de distribution (Q) couverte en EUR	661.618	36.528	123.206	574.940
Action de Catégorie A de distribution (Q) couverte en SGD	615.337	223.638	213.109	625.866
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	573.414	600	42.735	531.279
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	308	-	-	308
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	986.261	21.846	39.219	968.888
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	36.182	-	-	36.182
Action de capitalisation de Catégorie A	34.384.225	4.543.038	7.222.312	31.704.951
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	2.286.740	48.037	478.519	1.856.258
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	7.182.249	1.226.816	2.596.633	5.812.432
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	566	-	-	566
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	5.416.279	8.369.875	8.677.072	5.109.082
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	110.232	6.194	77.759	38.667
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	4.561.732	1.294.632	945.325	4.911.039
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	245.338	15.523	97.818	163.043
Action de capitalisation de Catégorie AI	54.976	16.502	35.029	36.449
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	175.204	25.507	35.442	165.269
Action de distribution (D) de Catégorie C	195.274	1.022	52.011	144.285
Action de distribution (Q) de Catégorie C	590.451	6.913	71.012	526.352
Action de capitalisation de Catégorie C	5.161.892	387.498	1.486.430	4.062.960
Action de distribution (A) de Catégorie D	71.323	53.657	63.543	61.437
Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en CAD	1.124.157	72.353	342.077	854.433
Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	379.681	11	243.621	136.071
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.768.226	1.546.634	907.397	2.407.463
Action de distribution (Q) de Catégorie D	12.372.698	2.156.843	3.055.967	11.473.574
Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en CHF	1.651.654	99.734	156.733	1.594.655
Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en EUR	563.485	114.410	252.270	425.625
Action de capitalisation de Catégorie D	41.548.966	9.193.780	15.717.208	35.025.538
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	3.333.996	167.152	1.261.432	2.239.716
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	26.050.791	4.253.577	18.573.541	11.730.827
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	2.339.569	586.645	1.087.553	1.838.661
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	182.246	49.000	50.000	181.246
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	23.806	104.657	11.928	116.535
Action de capitalisation de Catégorie E	10.935.879	1.444.301	3.277.319	9.102.861
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	21.157.770	2.482.493	4.478.535	19.161.728
Action de Catégorie I de distribution (M) couverte en CAD	20.246.771	727.716	-	20.974.487
Action de distribution (Q) de Catégorie I	9.798.640	1.042.840	7.803.533	3.037.947
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	1.231.048	14.024	48.257	1.196.815
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en GBP	4.696.270	901.006	3.547.159	2.050.117
Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en JPY	599.858	125.887	29.890	695.855
Action de capitalisation de Catégorie I	86.709.351	7.494.121	11.510.644	82.692.828
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	25.244	2.526	16.655	11.115
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	4.670	100.000	-	104.670
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	10.073.745	17.410	731.137	9.360.018
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	47.582.007	7.354.178	11.588.784	43.347.401
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	30.105.506	192.300	18.372.836	11.924.970
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	45.259.957	4.836.697	3.181.985	46.914.669
Action de distribution (M) de Catégorie J	1.277.766	112.028	336.476	1.053.318
Action de Catégorie S de distribution (A) couverte en EUR	61.777	51.757	16.527	97.007
Action de Catégorie S de distribution (Q)	744.911	345.833	482.040	608.704
Action de capitalisation de Catégorie S	3.339.581	1.040.149	495.301	3.884.429
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en CHF	2.327.320	238.435	281.558	2.284.197
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	1.518.806	446.693	205.786	1.759.713
Action de Catégorie X de distribution (M)	59.491.501	37.223	203.125	59.325.599
Action de Catégorie X de distribution (M) couverte en AUD	917.062	34.909	203.172	748.799
Action de Catégorie X de distribution (M) couverte en EUR	185.604	7.536	15.497	177.643
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en EUR	14.543.302	20	-	14.543.322
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en GBP	4.463.746	-	2.414.197	2.049.549
Action de capitalisation de Catégorie X	103.797.640	2.057.389	687.085	105.167.944

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	6.239.648	5.652	329.275	5.916.025
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CAD	119.272.903	4.566.898	53.321.102	70.518.699
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF	13	-	-	13
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	56.329	-	56.323	6
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	46.588.783	2.249.985	46.501.015	2.337.753
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK	115	-	-	115
Future Consumer Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	26.810	10.514	7.030	30.294
Action de capitalisation de Catégorie AI	425	-	-	425
Action de capitalisation de Catégorie D	6.532	2.075	3.480	5.127
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	8.269	747	7.399	1.617
Action de capitalisation de Catégorie E	28.918	32.808	5.026	56.700
Action de capitalisation de Catégorie I	491	-	-	491
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.997.000	-	-	1.997.000
Action de capitalisation de Catégorie Z	500	-	-	500
Future Of Transport Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	548.661	158.055	28.347	678.369
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	621.631	12.631	104.585	529.677
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	268.157	133.076	135.081
Action de capitalisation de Catégorie A	26.583.703	4.553.856	7.659.665	23.477.894
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1.146.581	442.214	291.315	1.297.480
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	3.421.002	632.076	998.003	3.055.075
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	702.931	99.361	156.869	645.423
Action de capitalisation de Catégorie AI	3.059.929	605.184	1.311.078	2.354.035
Action de capitalisation de Catégorie C	-	445	-	445
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1.158.325	741.964	804.494	1.095.795
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	13.177.570	12.631.639	17.415.533	8.393.676
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	883.182	98.173	308.404	672.951
Action de capitalisation de Catégorie E	25.860.309	5.328.130	5.936.622	25.251.817
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	20.252.445	2.213.434	3.921.793	18.544.086
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	26.484	-	26.984
Action de capitalisation de Catégorie I	12.854.899	14.139.537	3.723.723	23.270.713
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	600.086	639.192	240.090	999.188
Action de capitalisation de Catégorie X	405.392	22.358	403.106	24.644
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	7.061.561	-	7.062.061

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Global Allocation Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	17.604.736	1.737.452	2.101.731	17.240.457
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	1.543.275	29.383	457.375	1.115.283
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	500	-	500
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	-	725	-	725
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	-	357	-	357
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en EUR	-	447	-	447
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	-	391	-	391
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en SGD	-	661	-	661
Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en ZAR	-	897	-	897
Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G)	500	-	-	500
Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G) couverte en AUD	659	-	-	659
Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G) couverte en SGD	671	-	-	671
Action de capitalisation de Catégorie A	101.005.256	8.025.472	17.412.325	91.618.403
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	9.677.733	636.263	1.272.540	9.041.456
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1.976.802	135.358	292.190	1.819.970
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1.023.898	616.441	379.551	1.260.788
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	21.760.112	6.298.861	8.727.475	19.331.498
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	2.254.257	163.633	326.792	2.091.098
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	12.206.707	8.291.069	8.927.494	11.570.282
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	2.043.045	352.834	812.710	1.583.169
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	5.666.392	566.939	886.052	5.347.279
Action de capitalisation de Catégorie AI	679.806	142.487	279.491	542.802
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	435.504	53.691	254.566	234.629
Action de capitalisation de Catégorie C	7.432.839	441.347	1.053.187	6.820.999
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	1.742.541	138.970	371.346	1.510.165
Action de distribution (A) de Catégorie D	395.599	146.416	63.549	478.466
Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	237.054	18.703	54.311	201.446
Action de capitalisation de Catégorie D	4.023.133	1.668.375	1.051.154	4.640.354
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	378.898	24.190	101.022	302.066
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	244.331	37.535	45.678	236.188
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	6.502.621	1.202.002	1.890.657	5.813.966
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	1.086.894	167.745	181.546	1.073.093
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	27.362	-	14.166	13.196
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	121.602	67.555	50.377	138.780
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	10.426.228	2.182.266	2.756.862	9.851.632
Action de capitalisation de Catégorie E	23.046.329	3.779.582	6.141.084	20.684.827
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	10.857.252	781.301	1.665.704	9.972.849
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en PLN	251.548	40.690	43.526	248.712
Action de capitalisation de Catégorie I	11.086.556	1.301.609	4.383.241	8.004.924
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	4.322.605	855.805	2.476.653	2.701.757
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SGD	15	-	-	15
Action de capitalisation de Catégorie J	202.000	-	44.432	157.568
Action de capitalisation de Catégorie S	-	4.741	-	4.741
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	-	458	-	458
Action de distribution (A) de Catégorie X	37.772.778	3.620.378	5.771.215	35.621.941
Action de capitalisation de Catégorie X	9.335.941	445.962	1.504.576	8.277.327
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	3.813.652	124.403	606.955	3.331.100
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	450	-	-	450
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY	3.053.845	80.834	641.969	2.492.710

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Global Corporate Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	170.833	3.915	1.061	173.687
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	–	500	–	500
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	138.566	74.478	34.717	178.327
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CAD	133.948	20.106	–	154.054
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	69.173	26.790	15.949	80.014
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	333.712	14.973	19.830	328.855
Action de distribution (Q) de Catégorie A	77.298	23.824	29.045	72.077
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	2.081.486	971.651	724.885	2.328.252
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1.622.700	12.695.505	2.129.481	12.188.724
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	121.878	30.247	3.158	148.967
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	14.133.536	5.752.320	3.870.970	16.014.886
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	587.696	65.126	288.187	364.635
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	89.580	3.137.047	168.183	3.058.444
Action de capitalisation de Catégorie A	5.408.192	6.334.604	3.340.658	8.402.138
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	2.537.573	257.676	234.760	2.560.489
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	4.068	217	2.041	2.244
Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en GBP	370	–	–	370
Action de capitalisation de Catégorie D	1.340.266	1.864.662	200.562	3.004.366
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	7.178.123	2.181.406	5.715.320	3.644.209
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.137.310	3.247.701	3.277.569	2.107.442
Action de capitalisation de Catégorie E	505.345	46.180	99.431	452.094
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	744.094	209.575	128.368	825.301
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	106.784	–	58.463	48.321
Action de capitalisation de Catégorie I	6.206.047	3.254.450	787.992	8.672.505
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	590	–	–	590
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	4.927.885	4.147.557	3.669.629	5.405.813
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	7	–	–	7
Action de capitalisation de Catégorie X	1.750.953	238.300	613.541	1.375.712
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	15.979.723	625.833	11.608.890	4.996.666
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	644.421	85.228	–	729.649
Global Dynamic Equity Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	61.983	3.282	9.867	55.398
Action de capitalisation de Catégorie A	8.831.429	970.793	3.373.980	6.428.242
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	310	3.305	–	3.615
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	305.617	51.487	40.061	317.043
Action de capitalisation de Catégorie C	1.245.675	52.298	155.984	1.141.989
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	134.864	123.494	96.377	161.981
Action de distribution (A) de Catégorie D	398.886	23.326	42.998	379.214
Action de capitalisation de Catégorie D	2.037.149	186.562	388.963	1.834.748
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	67.368	9.811	24.364	52.815
Action de capitalisation de Catégorie E	2.008.822	198.849	223.045	1.984.626
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	193.531	15.705	25.919	183.317
Action de capitalisation de Catégorie I	6.082.343	6.418.928	7.337.348	5.163.923
Action de capitalisation de Catégorie X	7	–	–	7

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Global Equity Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	1.161.462	86.039	243.168	1.004.333
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR	80.819	1.638	499	81.958
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	4.805.980	141.735	877.010	4.070.705
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en EUR	785.416	33.586	73.563	745.439
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD	1.031.716	196.191	145.906	1.082.001
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.484.050	221.565	149.111	1.556.504
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1.911.828	133.541	390.010	1.655.359
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	86.495	451	22.744	64.202
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	220.223	235.498	232.105	223.616
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	5.507.892	277.254	1.097.439	4.687.707
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	144.551	4.393	15.783	133.161
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	69.036	9.249	18.976	59.309
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	5.067.120	201.680	594.234	4.674.566
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	36.137	18.391	17.746
Action de capitalisation de Catégorie A	15.428.394	1.043.859	5.810.604	10.661.649
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	420.679	35.970	50.112	406.537
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1.116.075	330.851	303.385	1.143.541
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	2.661.542	7.156.973	7.890.123	1.928.392
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	666.930	140.545	85.197	722.278
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	538.188	127.365	253.924	411.629
Action de capitalisation de Catégorie AI	157.872	165.527	83.726	239.673
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	31.667	45.292	8.571	68.388
Action de Catégorie C de distribution (Q) (G)	1.209.955	15.101	152.447	1.072.609
Action de capitalisation de Catégorie C	2.037.516	37.625	282.285	1.792.856
Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	619.781	45.621	50.911	614.491
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G)	793.380	74.162	215.568	651.974
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) couverte en EUR	176.820	32.789	16.376	193.233
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	213.293	91.158	111.080	193.371
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	150.241	17.482	69.231	98.492
Action de capitalisation de Catégorie D	5.004.844	1.011.127	2.471.817	3.544.154
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	262.338	5	20.700	241.643
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	315.231	55.501	209.025	161.707
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	1.397	-	-	1.397
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	11.723	-	2.250	9.473
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	1.415.413	102.814	304.097	1.214.130
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	1.165.567	73.241	238.398	1.000.410
Action de capitalisation de Catégorie E	1.128.943	152.503	219.805	1.061.641
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	69.234	32.349	12.171	89.412
Action de capitalisation de Catégorie I	6.851.367	1.433.584	2.073.413	6.211.538
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	5.318.927	500.252	4.818.675
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G)	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie SR	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie X	9	-	-	9

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Global Government Bond Fund				
Action de distribution (D) de Catégorie A	40.208	3.153	5.496	37.865
Action de Catégorie A de distribution (D) couverte en EUR	17.532	51.129	68	68.593
Action de distribution (M) de Catégorie A	468.842	153.998	221.174	401.666
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	75.020	15.413	10.051	80.382
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	66.513	43.862	22.138	88.237
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en HKD	390	1	1	390
Action de capitalisation de Catégorie A	4.022.093	1.899.464	1.808.687	4.112.870
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	6.485.003	12.864.524	10.919.904	8.429.623
Action de distribution (D) de Catégorie C	6.190	–	–	6.190
Action de Catégorie C de distribution (D) couverte en EUR	5.030	–	3.290	1.740
Action de distribution (M) de Catégorie C	6	–	–	6
Action de capitalisation de Catégorie C	95.049	55.359	34.562	115.846
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	207.586	138.280	70.267	275.599
Action de distribution (M) de Catégorie D	30.182	78	6.275	23.985
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en EUR	3.827	–	3.823	4
Action de capitalisation de Catégorie D	394.819	548.746	298.347	645.218
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	6.479.906	4.849.920	3.487.080	7.842.746
Action de capitalisation de Catégorie E	522.117	82.425	81.652	522.890
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2.955.425	1.942.927	429.795	4.468.557
Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	431	1.908.426	18.846	1.890.011
Action de capitalisation de Catégorie I	2.481.834	4.288.731	615.975	6.154.590
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	4.798.632	6.073.421	2.329.747	8.542.306
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	1.141.795	534.017	–	1.675.812
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	647.353	88.112	–	735.465
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK	24.883.514	1.456.168	6.347.571	19.992.111
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	31.884	6.399	5.349	32.934

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Global High Yield Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution (D) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.508.028	43.931	543.733	1.008.226
Action de Catégorie A de distribution (D) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	729.678	134.724	254.079	610.323
Action de distribution (M) de Catégorie A	8.337.121	1.210.678	2.404.391	7.143.408
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	2.216.254	481.977	495.915	2.202.316
Action de distribution (Q) de Catégorie A	140.754	155.896	24.601	272.049
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	8.711.524	371.083	1.708.095	7.374.512
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	3.279.272	294.671	693.407	2.880.536
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	30.289	16.409	10.382	36.316
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	39.035.228	2.694.445	7.978.832	33.750.841
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1.881.509	120.928	563.996	1.438.441
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1.064.969	80.203	112.391	1.032.781
Action de capitalisation de Catégorie A	7.045.422	5.681.927	5.487.537	7.239.812
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	2.619.992	202.835	368.480	2.454.347
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	819.954	60.399	119.596	760.757
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	2.693.755	76.228	635.285	2.134.698
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	3.493.700	508.642	1.392.948	2.609.394
Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	68.209	3.764	25.636	46.337
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	25.673	8.405	14.822	19.256
Action de distribution (D) de Catégorie C	260.476	8.366	5	268.837
Action de capitalisation de Catégorie C	559.432	82.210	71.773	569.869
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	777.174	50.138	111.949	715.363
Action de distribution (M) de Catégorie D	6.179.830	3.326.023	3.340.904	6.164.949
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en EUR	461.971	427.688	237.506	652.153
Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en GBP	1.617.388	193.567	687.538	1.123.417
Action de capitalisation de Catégorie D	6.178.697	2.123.696	3.347.162	4.955.231
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	6.502.679	1.742.616	3.564.993	4.680.302
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	316.910	127.225	244.083	200.052
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	5.886.424	589.005	1.114.012	5.361.417
Action de capitalisation de Catégorie E	2.282.667	414.042	525.738	2.170.971
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2.526.032	370.808	568.948	2.327.892
Action de Catégorie I de distribution (M)	14.200.454	3.646.010	3.323.379	14.523.085
Action de capitalisation de Catégorie I	9.775.396	1.086.820	1.571.467	9.290.749
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	590	-	-	590
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	8.020.229	8.780.261	5.541.723	11.258.767
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	457	-	-	457
Action de Catégorie X de distribution (A) couverte en EUR	2.961.505	-	-	2.961.505
Action de capitalisation de Catégorie X	9.156	5.955	5.600	9.511
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	2.130.160	-	-	2.130.160
Global Inflation Linked Bond Fund				
Action de distribution (M) de Catégorie A	145.748	10.386	83.083	73.051
Action de capitalisation de Catégorie A	3.523.608	945.450	1.708.837	2.760.221
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	771.878	35.604	186.177	621.305
Action de distribution (M) de Catégorie C	28.828	-	-	28.828
Action de capitalisation de Catégorie C	346.138	11.659	156.475	201.322
Action de distribution (M) de Catégorie D	1.737	-	-	1.737
Action de capitalisation de Catégorie D	1.721.628	450.533	1.010.374	1.161.787
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	3.409.599	729.353	1.108.809	3.030.143
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	13.629.415	340.108	3.360.196	10.609.327
Action de capitalisation de Catégorie I	2.562.839	-	2.370.047	192.792
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	375.679	68.072	97.039	346.712
Global Long-Horizon Equity Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	14.807	4.501	1.540	17.768
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	939.648	5.032	52.921	891.759
Action de capitalisation de Catégorie A	8.304.168	2.270.647	1.407.153	9.167.662
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	4.669	626	1.353	3.942
Action de capitalisation de Catégorie AI	187.604	34.651	71.490	150.765
Action de capitalisation de Catégorie C	502.391	65.853	123.921	444.323
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	366.644	1.857.090	451.263	1.772.471
Action de capitalisation de Catégorie D	1.934.123	1.478.756	493.997	2.918.882
Action de capitalisation de Catégorie E	1.710.947	415.488	262.341	1.864.094
Action de capitalisation de Catégorie I	2.087.146	294.482	719.001	1.662.627
Action de capitalisation de Catégorie X	2.569.970	307.838	336.785	2.541.023

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Global Multi-Asset Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	1.927.916	723.658	86.407	2.565.167
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en CHF	57.419	–	2.568	54.851
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR	3.744.091	372.782	573.613	3.543.260
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	106.200.607	5.725.824	8.705.833	103.220.598
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	6.477.171	579.547	994.669	6.062.049
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en AUD	643.603	32.064	25.881	649.786
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD	1.162.470	79.512	174.262	1.067.720
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	19.774.195	325.634	3.837.887	16.261.942
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	2.652.433	268.576	764.364	2.156.645
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	747.624	121.489	214.972	654.141
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en GBP	5.117.293	366.291	1.083.900	4.399.684
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	4.519.222	391.815	518.262	4.392.775
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	148.083.409	6.602.239	28.656.064	126.029.584
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	21.301.253	7.564.167	3.993.604	24.871.816
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	8.011.975	430.274	2.461.189	5.981.060
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	86.123.606	3.473.534	15.540.416	74.056.724
Action de capitalisation de Catégorie A	29.467.030	3.408.611	9.058.615	23.817.026
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	67.897	–	5.381	62.516
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	3.470.601	579.367	1.244.388	2.805.580
Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	462.476	25.567	323.195	164.848
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	70.921	9.193	23.092	57.022
Action de Catégorie C de distribution (S) (M) (G)	1.804.744	24.809	307.562	1.521.991
Action de capitalisation de Catégorie C	1.712.208	6.111	351.476	1.366.843
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en CHF	181.390	–	24.500	156.890
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en EUR	1.979.055	164.927	573.001	1.570.981
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	91.683.654	14.561.915	7.751.870	98.493.699
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	378.243	27.594	46.048	359.789
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	695	–	–	695
Action de capitalisation de Catégorie D	7.812.469	1.532.440	3.710.495	5.634.414
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	12.780	–	9.100	3.680
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	2.342.451	192.591	683.897	1.851.145
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	52.354.901	2.340.410	11.755.861	42.939.450
Action de Catégorie E de distribution (Y) (Q) (G) couverte en EUR	6.374.401	143.350	1.573.015	4.944.736
Action de capitalisation de Catégorie E	7.839.416	1.356.725	2.010.539	7.185.602
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	5.355.930	1.856.188	1.052.462	6.159.656
Action de Catégorie I de distribution (Q) (G) couverte en EUR	314.721	–	4.751	309.970
Action de capitalisation de Catégorie I	12.932.272	1.034.701	3.382.601	10.584.372
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	7.846.155	801.738	5.233.088	3.414.805
Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) couverte en GBP	380	–	–	380
Action de Catégorie X de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	4.839.399	928.880	4.165.842	1.602.437
Action de capitalisation de Catégorie X	193.707	10.848	120.191	84.364
Impact Bond Fund⁽²⁾				
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	500	–	500
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	500	–	500
Action de capitalisation de Catégorie E	–	468	–	468
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	500	–	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	7.497.000	–	7.497.000
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	–	488	–	488
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	500	–	500
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	500	–	500
India Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	46.393	3.843	8.909	41.327
Action de capitalisation de Catégorie A	5.303.349	2.426.800	2.465.438	5.264.711
Action de capitalisation de Catégorie C	250.738	38.476	69.432	219.782
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	151.389	43.564	39.251	155.702
Action de capitalisation de Catégorie D	251.526	76.905	91.332	237.099
Action de capitalisation de Catégorie E	830.196	111.076	169.509	771.763
Action de capitalisation de Catégorie I	13.617.254	1.595.768	1.949.388	13.263.634
Action de capitalisation de Catégorie X	849.541	760.380	250.046	1.359.875

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Japan Flexible Equity Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	73.581	9.292	4.871	78.002
Action de capitalisation de Catégorie A	4.512.175	5.677.338	6.611.299	3.578.214
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	143.061	203.750	98.458	248.353
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	538.457	1.172.809	1.027.587	683.679
Action de capitalisation de Catégorie C	1.633.008	170.301	1.011.752	791.557
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	132.601	35.209	112.640	55.170
Action de capitalisation de Catégorie D	3.724.408	708.144	2.826.461	1.606.091
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1.266.797	1.002.166	867.548	1.401.415
Action de capitalisation de Catégorie E	1.079.181	2.847.459	2.801.848	1.124.792
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1.815.521	210.271	388.919	1.636.873
Action de capitalisation de Catégorie I	85.905	3.534.980	428.747	3.192.138
Action de capitalisation de Catégorie X	397.181	12.568	106.018	303.731
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	448	-	-	448
Japan Small & MidCap Opportunities Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	233	1.050	-	1.283
Action de capitalisation de Catégorie A	1.675.461	525.676	554.734	1.646.403
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	43.707	6.693	20.328	30.072
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	610.753	564.777	620.147	555.383
Action de capitalisation de Catégorie C	26.252	350	4.316	22.286
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	3.993	2.818	4.559	2.252
Action de capitalisation de Catégorie D	331.609	4.323	67.028	268.904
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	3.248	890	153	3.985
Action de capitalisation de Catégorie E	147.130	37.266	43.958	140.438
Action de capitalisation de Catégorie I	478	-	-	478
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	430	-	-	430
Action de capitalisation de Catégorie X	2.126	-	2.123	3
Latin American Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	29.883	3.731	4.376	29.238
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	10.617	1.106	2.373	9.350
Action de capitalisation de Catégorie A	12.115.267	3.392.793	4.515.888	10.992.172
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	657.955	343.865	483.768	518.052
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	9.709	14.482	1.630	22.561
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	147.967	64.046	33.699	178.314
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	2.794.404	8.601.050	8.512.421	2.883.033
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	645.744	605.799	415.535	836.008
Action de capitalisation de Catégorie C	86.067	49.568	51.810	83.825
Action de distribution (A) de Catégorie D	1.203	-	-	1.203
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	21.167	45.866	25.723	41.310
Action de capitalisation de Catégorie D	1.365.548	294.026	577.048	1.082.526
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	39.917	-	-	39.917
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	4.522	28.764	13.577	19.709
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	1.592	-	-	1.592
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	790	-	-	790
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	7.337	54.564	24.028	37.873
Action de capitalisation de Catégorie E	438.999	106.071	220.141	324.929
Action de capitalisation de Catégorie I	326.487	796.208	529.380	593.315
Action de capitalisation de Catégorie J	146.399	9.583	22.990	132.992
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	64	-	-	64
Action de capitalisation de Catégorie X	894	738	1.207	425
Multi-Theme Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	2.903.243	608.521	450.430	3.061.334
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	422	-	-	422
Action de capitalisation de Catégorie AI	56.339	714.591	43.936	726.994
Action de capitalisation de Catégorie C	37.532	18.525	840	55.217
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	17.962	3.060	1.780	19.242
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	898.237	859.346	942.002	815.581
Action de capitalisation de Catégorie E	1.570.762	862.924	235.578	2.198.108
Action de capitalisation de Catégorie X	332	-	-	332
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	4.398.152	613.904	2.739.020	2.273.036
Action de capitalisation de Catégorie Z	6.214.328	122.953	2.700.677	3.636.604

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Natural Resources Fund⁽⁷⁾				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	277.129	133.550	79.279	331.400
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	10.235	213.131	189.642	33.724
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	810.376	292.461	365.263	737.574
Action de capitalisation de Catégorie A	16.848.204	5.302.458	11.607.794	10.542.868
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1.267.178	349.713	657.005	959.886
Action de capitalisation de Catégorie D	69.070	459.247	86.073	442.244
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1.055.899	321.353	1.068.756	308.496
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	2.150.670	1.180.649	1.695.050	1.636.269
Action de capitalisation de Catégorie E	6.840.009	2.562.023	3.406.239	5.995.793
Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	8.771.202	1.808.404	2.895.185	7.684.421
Action de Catégorie S de distribution (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	403	-	403
Action de Catégorie S de distribution (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	-	17.578	5.930	11.648
Action de Catégorie S de distribution (Q) (G)	-	214.640	18.314	196.326
Action de capitalisation de Catégorie S	-	1.519.941	84.705	1.435.236
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	425.096	8.902	416.194
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	-	12.175	-	12.175
Next Generation Health Care Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	35.418	35.951	12.761	58.608
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	388	-	-	388
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	4.675	39.169	7.588	36.256
Action de capitalisation de Catégorie AI	425	-	-	425
Action de capitalisation de Catégorie D	63.940	17.627	56.844	24.723
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3.885	-	3.000	885
Action de capitalisation de Catégorie E	61.441	37.025	11.315	87.151
Action de capitalisation de Catégorie I	485	-	-	485
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.996.000	-	-	1.996.000
Action de capitalisation de Catégorie Z	500	-	-	500

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Next Generation Technology Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	775.682	361.417	95.336	1.041.763
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	5.029	6.248	-	11.277
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	500	-	500
Action de capitalisation de Catégorie A	54.506.693	9.628.815	16.058.371	48.077.137
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	672	-	-	672
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	24.918	397.147	114.384	307.681
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	8.373.960	1.730.318	2.626.428	7.477.850
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	95.597	1.481.521	1.075.697	501.421
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	731	-	-	731
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	2.988.012	695.744	601.887	3.081.869
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	163.496	11.534	8.870	166.160
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	64.473	459.606	171.987	352.092
Action de capitalisation de Catégorie AI	3.282.648	319.831	1.049.589	2.552.890
Action de capitalisation de Catégorie C	-	445	-	445
Action de capitalisation de Catégorie D	5.091.217	2.816.129	4.211.379	3.695.967
Action de capitalisation de Catégorie D couverte en CNH	323	-	-	323
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	8.321.507	7.562.817	15.217.614	666.710
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	671.444	411.794	157.486	925.752
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	7.213.737	2.355.161	3.499.438	6.069.460
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	3.667.724	363.983	1.341.185	2.690.522
Action de capitalisation de Catégorie E	29.836.221	5.161.736	4.362.073	30.635.884
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	17.469.125	2.891.437	2.776.136	17.584.426
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	82.863	-	-	82.863
Action de capitalisation de Catégorie I	17.829.923	3.088.319	5.217.574	15.700.668
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1.878.139	765.892	468.124	2.175.907
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.430.023	70.703	731.383	769.343
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	24.614.443	1.047.156	6.916.381	18.745.218
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	691.463	83.005	127.479	646.989
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3.619.404	240.583	1.172.375	2.687.612
Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	278.922	27.693	151.229	155.386
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	98.439	-	17.632	80.807
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	51.392	47.424	97.816	1.000
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	409	-	-	409
Action de capitalisation de Catégorie X	282.675	47.748	182.698	147.725
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.073.148	328.925	112.923	1.289.150
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	9.363	1.000	-	10.363
Nutrition Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	34.494	601	14.652	20.443
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	200	-	700
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	47.722	4.013	4.303	47.432
Action de capitalisation de Catégorie A	2.617.885	323.097	794.226	2.146.756
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	606.735	66.409	114.666	558.478
Action de Catégorie A de capitalisation en HKD	326.437	45.975	137.856	234.556
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	711.419	174.813	308.328	577.904
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1.090.494	37.064	246.000	881.558
Action de capitalisation de Catégorie AI	446.926	49.226	190.804	305.348
Action de capitalisation de Catégorie C	700.549	59.618	123.924	636.243
Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	14.859	-	452	14.407
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	51.685	3.644	7.987	47.342
Action de capitalisation de Catégorie D	3.493.273	2.033.414	2.490.210	3.036.477
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	713.967	60.740	689.376	85.331
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	72.221	34.489	14.402	92.308
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	46.666	8.437	25.261	29.842
Action de capitalisation de Catégorie E	8.311.801	968.428	1.551.885	7.728.344
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie I	6.190.123	95.316	2.076.583	4.208.856
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	553	-	-	553
Action de capitalisation de Catégorie X	331.158	646.057	219.167	758.048

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Sustainable Asian Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	878	17	17	878
Action de capitalisation de Catégorie A	500	429	-	929
Action de capitalisation de Catégorie D	18.903	-	-	18.903
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	500	-	-	500
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	9.133	3.084	449	11.768
Action de capitalisation de Catégorie I	2.946.558	8.086.667	-	11.033.225
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie X	1.996.849	575.833	572.091	2.000.591
Action de capitalisation de Catégorie Z	500	-	-	500
Action de Catégorie ZI de distribution (S) (M) (G)	-	500	-	500
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	500	-	500
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	1.220	-	-	1.220
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	2.897	2.191	987	4.101
Action de capitalisation de Catégorie AI	470	-	-	470
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	460	-	-	460
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	497	-	-	497
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	19.243	-	10.782	8.461
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	941	-	-	941
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	35.773	9.723	2.595	42.901
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1.135.045	21.586	230.781	925.850
Action de capitalisation de Catégorie I	1.002	-	-	1.002
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	430	-	-	430
Action de capitalisation de Catégorie X	2.498.000	-	312.175	2.185.825
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	955.755	80.738	146.047	890.446
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	500	-	500
Sustainable Emerging Markets Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	663	-	-	663
Action de capitalisation de Catégorie A	657.546	677.674	314.998	1.020.222
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	35.103	135.246	21.379	148.970
Action de capitalisation de Catégorie AI	3.199	-	-	3.199
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	6.065	2.137	-	8.202
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	2.564.614	1.407.450	877.620	3.094.444
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	303.045	241.265	49.801	494.509
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	306.160	188.794	220.847	274.107
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	363	1.705	734	1.334
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	516.416	90.871	143.197	464.090
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	649.762	68.488	111.910	606.340
Action de capitalisation de Catégorie I	87.006	3.401	86.110	4.297
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	22.926.761	1.784.733	21.433.887	3.277.607
Action de capitalisation de Catégorie I couverte en NOK	-	1.750.381	-	1.750.381
Action de capitalisation de Catégorie X	1.110.649	213.042	888.051	435.640
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	740	-	-	740
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	10.409.071	704.037	305.710	10.807.398
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	500	-	500
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	271.543	199	269.999	1.743
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	943.729	390.638	1.264.658	69.709
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1.245	148.504	786	148.963
Action de capitalisation de Catégorie AI	2.664	-	-	2.664
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	460	-	-	460
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	145.084	143.522	39.460	249.146
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	662.347	544.876	475.208	732.015
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	70.194	11.942	41.642	40.494
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	50.428	9.386	2.141	57.673
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	529.380	138.677	92.593	575.464
Action de capitalisation de Catégorie I	128.518	1.062.191	860.525	330.184
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1.971.196	350.026	1.754.506	566.716
Action de capitalisation de Catégorie X	3.079.351	31	874.952	2.204.430
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	500	-	500

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	126.792	526.932	292.135	361.589
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	428	50.991	49.163	2.256
Action de capitalisation de Catégorie AI	470	8.585	–	9.055
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	2.700	11.999	–	14.699
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	497	–	–	497
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	27.523	687.316	470.514	244.325
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	225.685	47.051	137.798	134.938
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	6.804	778	429	7.153
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	98.874	51.700	20.103	130.471
Action de capitalisation de Catégorie I	12.609.400	5.479.300	1.434.028	16.654.672
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	435	–	–	435
Action de capitalisation de Catégorie X	33.536.035	3.108.865	7.194.869	29.450.031
Action de capitalisation de Catégorie ZI	–	500	–	500
Sustainable Energy Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	6.801.749	1.823.989	571.977	8.053.761
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.007.415	313.388	467.724	1.853.079
Action de Catégorie A de distribution (T)	–	73.166	8.347	64.819
Action de capitalisation de Catégorie A	182.317.913	30.209.088	42.470.974	170.056.027
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	521.077	527.801	386.335	662.543
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	167.152	519.477	501.225	185.404
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1.388.599	547.993	509.436	1.427.156
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	5.772.254	2.576.449	2.775.874	5.572.829
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	331.574	113.121	173.435	271.260
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1.204.864	128.302	487.268	845.898
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	50.924	164.843	185.368	30.399
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	6.167.033	1.212.124	1.749.823	5.629.334
Action de capitalisation de Catégorie AI	10.010.624	1.293.171	4.744.767	6.559.028
Action de capitalisation de Catégorie C	13.501.873	2.692.085	2.210.404	13.983.554
Action de distribution (A) de Catégorie D	6.587.432	940.572	1.573.300	5.954.704
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	11.271.963	3.457.299	2.857.426	11.871.836
Action de capitalisation de Catégorie D	37.892.542	11.878.601	8.555.058	41.216.085
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	19.075	57.994	12.500	64.569
Action de capitalisation de Catégorie E	99.439.179	20.186.456	23.388.950	96.236.685
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	3.838.745	799.203	1.194.128	3.443.820
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	3.267.941	309.746	650.814	2.926.873
Action de distribution (Q) de Catégorie I	744.317	1.052.681	–	1.796.998
Action de capitalisation de Catégorie I	16.895.045	1.647.618	3.297.090	15.245.573
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	20.506.708	4.941.129	3.121.426	22.326.411
Action de Catégorie S de distribution (A)	–	447	–	447
Action de capitalisation de Catégorie S	547.857	17.323	39.353	525.827
Action de Catégorie X de distribution (T)	160.370	46.848	138.158	69.060
Action de capitalisation de Catégorie X	7.004.685	330.890	2.626.227	4.709.348
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	2.420.955	1.596.687	1.794.773	2.222.869

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	465	–	–	465
Action de capitalisation de Catégorie AI	6.470	–	–	6.470
Action de capitalisation de Catégorie D	76.238	120.280	59.652	136.866
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	485	–	–	485
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie E	183.568	141.893	50.022	275.439
Action de capitalisation de Catégorie I	4.557.274	264.622	2.845.674	1.976.222
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	2.022.885	–	–	2.022.885
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	5.182.791	428.771	2.104.111	3.507.451
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	2.049.822	158.564	752.513	1.455.873
Action de Catégorie X de distribution (M)	19.871.288	17	–	19.871.305
Action de Catégorie X de distribution (Q)	8.035.690	19	–	8.035.709
Action de capitalisation de Catégorie X	7.370.760	1.974.199	1.650.263	7.694.696
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF	490	–	–	490
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	405	1.365.660	–	1.366.065
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY	538	–	–	538
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK	11.809.758	332.336	789.460	11.352.634
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie ZI	–	516	–	516
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en USD	–	500	–	500
Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	516	–	516
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	–	528	–	528
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	1.013	–	1.013
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	–	516	–	516
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	1.013	–	1.013
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	–	516	–	516
Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	516	–	516
Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	–	516	–	516
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	1.254.292	274.140	980.152
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	–	516	–	516
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	7.493.500	–	7.493.500
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	500	–	500
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	–	516	–	516

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Sustainable Global Bond Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	–	500	–	500
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	344	–	–	344
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	166.761	25.367	45.248	146.880
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en AUD	718	130.773	–	131.491
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CAD	673	–	–	673
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1.796.664	31.047	274.902	1.552.809
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.385	10.000	12.000	385
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	394	–	–	394
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en NZD	14.160	–	–	14.160
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	26.869	23.118	18.934	31.053
Action de capitalisation de Catégorie A	7.935	35.327	3.835	39.427
Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	60.558	35.477	50.718	45.317
Action de capitalisation de Catégorie AI	2.890	10.052	5.114	7.828
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	13.125	–	7.278	5.847
Action de capitalisation de Catégorie D	302.904	–	255.018	47.886
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	503	–	–	503
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	430	–	–	430
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	40.491	10.745	8.061	43.175
Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	85.430	129.480	16.470	198.440
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	221.065	134.893	57.532	298.426
Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	2.112.796	22	–	2.112.818
Action de capitalisation de Catégorie I	316.598	545.004	860.597	1.005
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	1.883.482	379.288	511.106	1.751.664
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	435	–	–	435
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	–	515	–	515
Action de capitalisation de Catégorie X	5.328.134	–	750.509	4.577.625
Action de capitalisation de Catégorie Z	128.837	–	9.695	119.142
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	35.000	–	–	35.000
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	51.835	–	13.200	38.635
Action de capitalisation de Catégorie ZI	–	500	–	500
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR	–	509	–	509
Sustainable Global Infrastructure Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	11.509	3.646	8.215	6.940
Action de capitalisation de Catégorie AI	3.105	–	–	3.105
Action de capitalisation de Catégorie D	981	3	–	984
Action de capitalisation de Catégorie E	66.225	121.842	14.021	174.046
Action de capitalisation de Catégorie I	425	–	–	425
Action de capitalisation de Catégorie X	998.500	–	–	998.500
Action de capitalisation de Catégorie Z	500	–	–	500

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾				
Action de distribution (D) de Catégorie A	100.985	2.435	75.249	28.171
Action de distribution (M) de Catégorie A	200.673	71.556	61.310	210.919
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	5.826	2.554	–	8.380
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	21.233	1.317	216	22.334
Action de capitalisation de Catégorie A	1.088.332	136.786	351.078	874.040
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	235.080	45.335	170.321	110.094
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	380.127	104.280	86.740	397.667
Action de distribution (D) de Catégorie C	14.197	85	1.296	12.986
Action de distribution (M) de Catégorie D	69.194	1.388	3	70.579
Action de capitalisation de Catégorie D	1.743.877	823.280	1.119.552	1.447.605
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	526.909	–	29.499	497.410
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	79.158	16.554	11.250	84.462
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	2.267.755	768.216	800.711	2.235.260
Action de capitalisation de Catégorie E	465.044	130.959	88.527	507.476
Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	2.598.665	1.953.192	1.604.344	2.947.513
Action de capitalisation de Catégorie I	392.265	2.587.303	1.851.935	1.127.633
Action de capitalisation de Catégorie X	4.350.456	71.966	1.950.084	2.472.338
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF	8	–	–	8
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en DKK	5	–	–	5
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	242.391	21.213	5.440	258.164
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	17.080.519	–	754.776	16.325.743
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	40.693.062	5.408.709	–	46.101.771
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	795	–	–	795
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund⁽⁵⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	389.468	128	42.953	346.643
Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	259.310	10.660	144.559	125.411
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	321.315	1.203	52.643	269.875
Action de capitalisation de Catégorie I	8.739.108	–	2.344.104	6.395.004
Systematic China A-Share Opportunities Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	6.768.515	2.431.678	3.385.181	5.815.012
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	280.525	300.116	219.223	361.418
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	450	–	–	450
Action de capitalisation de Catégorie D	11.400.745	1.082.151	2.922.646	9.560.250
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	609.294	176.655	338.194	447.755
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.546.586	447.130	145.660	1.848.056
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	217.427	235.120	265.190	187.357
Action de capitalisation de Catégorie I	11.491.776	12.551.795	4.787.838	19.255.733
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	136.712	10.905	74.382	73.235
Action de capitalisation de Catégorie S	1.093.493	655.331	295.300	1.453.524
Action de capitalisation de Catégorie SR	500	–	–	500
Action de capitalisation de Catégorie X	8.095.495	1.232.181	929.772	8.397.904
Action de capitalisation de Catégorie Z	3.614.729	–	1.181.423	2.433.306
Systematic China Environmental Tech Fund⁽²⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	–	1.001	–	1.001
Action de capitalisation de Catégorie D	–	500	–	500
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	–	465	–	465
Action de capitalisation de Catégorie I	–	500	–	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	–	1.651.089	–	1.651.089
Action de capitalisation de Catégorie Z	–	500	–	500
Action de capitalisation de Catégorie ZI	–	500	–	500

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Systematic Global Equity High Income Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	37.513	298.869	60.412	275.970
Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en CHF	5.313	26.874	1.328	30.859
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	18.713.685	1.247.741	3.490.660	16.470.766
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en EUR	3.166.171	1.302.829	432.862	4.036.138
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	505.187	135.207	111.056	529.338
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	48.019.600	20.115.440	21.290.825	46.844.215
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	8.010.442	6.021.531	4.560.029	9.471.944
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	24.617.543	35.064.904	8.938.182	50.744.265
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	6.150.253	2.150.158	3.095.441	5.204.970
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1.229.805	807.136	752.297	1.284.644
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	249.652.387	243.044.489	220.175.376	272.521.500
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	-	453	-	453
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	70.489.444	20.888.535	30.288.865	61.089.114
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	435.295	917.568	228.692	1.124.171
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	11.077.832	3.684.767	4.690.813	10.071.786
Action de capitalisation de Catégorie A	10.950.933	3.315.089	4.179.917	10.086.105
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1.806.605	261.533	363.408	1.704.730
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	4.238	49.319	3.851	49.706
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	355.936	57.139	12.944	400.131
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	149.451	5.278	34.358	120.371
Action de Catégorie C de distribution (Q) (G)	515.349	820	199.482	316.687
Action de capitalisation de Catégorie C	87.304	5.657	12.459	80.502
Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	65.630	82.696	-	148.326
Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en CHF	45.928	193.724	29.648	210.004
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G)	11.097.909	1.494.363	1.459.734	11.132.538
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	5.813.987	1.241.482	592.747	6.462.722
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	3.208.567	1.046.402	1.711.001	2.543.968
Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.209.707	125.893	640.498	695.102
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	500	2.007.408	24.300	1.983.608
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	446.874	504.088	166.502	784.460
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	568.952	190.682	186.962	572.672
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.212.516	283.608	729.010	1.767.114
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	1.426.068	125.955	152.713	1.399.310
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	1.080.488	144.781	145.389	1.079.880
Action de capitalisation de Catégorie E	31.921	51.397	13.182	70.136
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	77.289	19.965	22.824	74.430
Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	500	73.642.843	8.480.720	65.162.623
Action de Catégorie I de distribution (M) (G)	1.894.064	185	-	1.894.249
Action de Catégorie I de distribution (Q) (G)	41.306.931	3.897.323	36.653.111	8.551.143
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	175.843	1.427.088	53.900	1.549.031
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	735.907	64.783	501.100	299.590
Action de capitalisation de Catégorie I	608.479	1.219	455.906	153.792
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G)	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie SR	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie X	578.379	41.316	83.570	536.125

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund⁽²⁾				
Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	855	-	855
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	500	-	500
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	-	54.616	-	54.616
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	-	6.626	-	6.626
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	-	11.743	5.354	6.389
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	9.857	-	9.857
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	-	399.034	-	399.034
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	500	-	500
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	-	504	-	504
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	-	468	-	468
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	500	-	500
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	-	504	-	504
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	1.494.500	-	1.494.500
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	500	-	500
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾				
Action de capitalisation de Catégorie A	1.424.149	280.725	209.789	1.495.085
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	439.995	43.005	44.067	438.933
Action de capitalisation de Catégorie C	74.159	6.172	17.542	62.789
Action de capitalisation de Catégorie D	131.057	70.513	73.112	128.458
Action de capitalisation de Catégorie E	93.738	36.628	23.428	106.938
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	760.161	265.679	436.989	588.851
United Kingdom Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	211.606	1.640	17.703	195.543
Action de capitalisation de Catégorie A	1.057.234	55.820	213.385	899.669
Action de capitalisation de Catégorie C	42.677	5.262	7.011	40.928
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	92.825	11.055	25.877	78.003
Action de capitalisation de Catégorie D	42.159	14.441	27.791	28.809
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	204.298	8.051	95.957	116.392
Action de capitalisation de Catégorie E	368.771	27.348	86.590	309.529
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.289.383	202.773	714.048	778.108
Action de capitalisation de Catégorie I	1.189.612	380.695	720.959	849.348
Action de capitalisation de Catégorie X	147.509	347	137.400	10.456
US Basic Value Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	16.245	6.252	5.700	16.797
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	7.284	103	4.517	2.870
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	15.408	9.926	5.482
Action de capitalisation de Catégorie A ⁽⁶⁾	3.773.530	865.432	1.292.744	3.346.218
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1.521	2.808	2.808	1.521
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	332.074	75.861	356.560	51.375
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	22.044	47	8.922	13.169
Action de capitalisation de Catégorie C	280.188	23.947	91.036	213.099
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	10.426	1.975	1.558	10.843
Action de distribution (A) de Catégorie D	70.098	465	106	70.457
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	12.054	8.061	10.129	9.986
Action de capitalisation de Catégorie D	1.029.419	1.441.540	618.638	1.852.321
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	11.838	276.304	94.479	193.663
Action de capitalisation de Catégorie E	572.929	35.147	82.400	525.676
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	108.222	13.916	40.659	81.479
Action de capitalisation de Catégorie I	958.986	584.134	284.772	1.258.348
Action de capitalisation de Catégorie X	8.952	-	938	8.014

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁶⁾ Les actions rachetées comprennent l'annulation des actions non attribuées qui ont été émises lors de la fusion d'ECS - US Basic Value dans US Basic Value Fund (fusion historique du Compartiment en 2002). L'annulation des actions n'a pas eu d'incidence négative sur la VL du Compartiment.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
US Dollar Bond Fund				
Action de distribution (D) de Catégorie A	510.550	109.524	139.349	480.725
Action de distribution (M) de Catégorie A	714.627	742.393	476.802	980.218
Action de capitalisation de Catégorie A	2.184.187	2.310.621	2.009.791	2.485.017
Action de distribution (D) de Catégorie C	546.140	3.395	152.546	396.989
Action de capitalisation de Catégorie C	237.681	65.221	107.503	195.399
Action de distribution (M) de Catégorie D	2.958.188	330.099	137.347	3.150.940
Action de capitalisation de Catégorie D	4.791.425	3.375.746	1.132.698	7.034.473
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	7.008	146	190	6.964
Action de capitalisation de Catégorie E	292.675	83.950	59.149	317.476
Action de distribution (Q) de Catégorie I	263.645	72.872	60.505	276.012
Action de capitalisation de Catégorie I	18.151.552	2.799.390	9.594.535	11.356.407
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	5.397.430	2.041.060	4.541.030	2.897.460
Action de Catégorie X de distribution (Q)	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie X	168.538	4.602	8.192	164.948
US Dollar High Yield Bond Fund				
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	104.359	3.077	301	107.135
Action de distribution (D) de Catégorie A	9.325.297	528.251	1.918.022	7.935.526
Action de distribution (M) de Catégorie A	17.098.452	2.044.759	5.867.675	13.275.536
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	1.258.350	1.100.982	909.868	1.449.464
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CAD	650.570	153.680	145.665	658.585
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	379.652	45.817	64.088	361.381
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	617.092	8.432	139.407	486.117
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	308.379	20.789	22.114	307.054
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en SGD	1.271.914	11.597	101.006	1.182.505
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	8.638.823	258.914	1.217.310	7.680.427
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1.717.156	249.534	447.289	1.519.401
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	45.215	57.215	532	101.898
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	165.208.335	12.090.653	47.319.782	129.979.206
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	15.535.128	1.712.579	11.374.182	5.873.525
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1.449.696	46.043	171.157	1.324.582
Action de capitalisation de Catégorie A	8.990.579	9.006.375	10.267.840	7.729.114
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	184.729	51.037	46.781	188.985
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	107.476	46.213	83.205	70.484
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	69.136	3.434	22.352	50.218
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	90.200	252.356	263.946	78.610
Action de distribution (D) de Catégorie C	637.630	5.072	86.932	555.770
Action de capitalisation de Catégorie C	316.879	16.322	66.774	266.427
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1.436.709	83.222	1.225.380	294.551
Action de distribution (M) de Catégorie D	12.221.460	1.963.731	4.418.368	9.766.823
Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en SGD	282.111	10.000	27.563	264.548
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	107.352	16.967	53.239	71.080
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	306.408	-	53.361	253.047
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	246.794	207.342	380.895	73.241
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	16.662	-	2.194	14.468
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	6.195.563	1.914.639	3.083.139	5.027.063
Action de capitalisation de Catégorie E	455.300	85.970	138.849	402.421
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	953	13.957	539	14.371
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	872.712	609.046	489.400	992.358
Action de Catégorie I de distribution (M)	15.705.324	127.795	11.119.069	4.714.050
Action de capitalisation de Catégorie I	22.593.825	3.487.605	4.046.664	22.034.766
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	3.143.684	1.065.980	3.958.445	251.219
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	449	-	-	449
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	382	-	-	382
Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	364	-	-	364
Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	52.588	63.548	115.636	500
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	291.662	77.559	253.294	115.927
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	15.051	-	-	15.051
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	4.697.932	299.837	-	4.997.769
Action de capitalisation de Catégorie X	393.926	59.173	70.190	382.909

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
US Dollar Reserve Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	2.729.063	5.477.957	5.488.212	2.718.808
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	61.296	14.319	14.478	61.137
Action de capitalisation de Catégorie C	119.308	31.401	61.015	89.694
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	535	1.765	1.960	340
Action de capitalisation de Catégorie E	183.383	42.408	84.490	141.301
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en GBP	8.530	13.728	3.012	19.246
Action de capitalisation de Catégorie X	988.952	759.803	969.866	778.889
US Dollar Short Duration Bond Fund				
Action de distribution (D) de Catégorie A	3.308.180	2.108.780	1.980.390	3.436.570
Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	-	500	-	500
Action de distribution (M) de Catégorie A	1.622.723	3.762.438	2.646.107	2.739.054
Action de distribution (M) de Catégorie A couverte en CNH	-	360	-	360
Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CNH	133.914	830.304	774.906	189.312
Action de capitalisation de Catégorie A	29.209.532	15.118.651	12.512.472	31.815.711
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	11.544.711	13.445.608	5.677.226	19.313.093
Action de capitalisation de Catégorie AI	85.176	106.771	74.347	117.600
Action de distribution (D) de Catégorie C	79.975	181	5.309	74.847
Action de capitalisation de Catégorie C	1.878.726	1.947.862	1.133.815	2.692.773
Action de distribution (M) de Catégorie D	11.722.962	3.078.724	4.387.144	10.414.542
Action de capitalisation de Catégorie D	38.431.341	13.025.050	20.544.884	30.911.507
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	982.026	4.951.730	2.496.993	3.436.763
Action de capitalisation de Catégorie E	6.846.358	1.192.455	2.913.601	5.125.212
Action de distribution (Q) de Catégorie I	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie I	6.568.581	3.763.266	2.258.999	8.072.848
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	5.793.538	1.844.722	5.420.533	2.217.727
Action de distribution (M) de Catégorie S	-	500	-	500
Action de capitalisation de Catégorie S	-	1.003	-	1.003
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	-	460	-	460
Action de capitalisation de Catégorie X	10.126.487	303.303	126.175	10.303.615
US Flexible Equity Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	66.490	33.020	8.840	90.670
Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	26.754	19.434	11.547	34.641
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	217.674	9.409	23.586	203.497
Action de capitalisation de Catégorie A	12.046.000	2.051.389	3.150.094	10.947.295
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	328	16.422	8.257	8.493
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CZK	-	1.061	-	1.061
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1.268.168	184.570	193.385	1.259.353
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	555	-	-	555
Action de capitalisation de Catégorie AI	61.199	19.064	51.646	28.617
Action de capitalisation de Catégorie C	544.466	50.240	73.897	520.809
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	51.982	13.037	22.448	42.571
Action de distribution (A) de Catégorie D	309	96	96	309
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	2.028.233	20.888	256.954	1.792.167
Action de capitalisation de Catégorie D	1.958.804	639.646	927.518	1.670.932
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1.546.449	878.682	1.553.411	871.720
Action de capitalisation de Catégorie E	812.192	302.305	266.996	847.501
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	400.529	116.997	113.331	404.195
Action de capitalisation de Catégorie I	14.339.607	14.124.572	9.106.805	19.357.374
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	430	3.410.944	118.603	3.292.771
Action de capitalisation de Catégorie X	579.729	123.621	47.349	656.001
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	448	-	-	448
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	-	389	-	389

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
US Government Mortgage Impact Fund				
Action de distribution (D) de Catégorie A	755.857	9.234	233.882	531.209
Action de distribution (M) de Catégorie A	269.995	6.121	22.190	253.926
Action de capitalisation de Catégorie A	1.546.416	192.218	320.752	1.417.882
Action de distribution (D) de Catégorie C	56.668	366	14.499	42.535
Action de capitalisation de Catégorie C	227.669	22.184	58.645	191.208
Action de distribution (M) de Catégorie D	564.005	308.814	474.870	397.949
Action de capitalisation de Catégorie D	1.672.336	456.251	632.683	1.495.904
Action de capitalisation de Catégorie E	448.958	33.891	108.144	374.705
Action de Catégorie I de distribution (M)	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie I	1.700.500	-	-	1.700.500
Action de Catégorie X de distribution (M)	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	500	-	500
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR	-	509	-	509
US Growth Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	25.594	4.013	3.028	26.579
Action de capitalisation de Catégorie A	652.131	768.585	521.380	899.336
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	268.568	544.207	109.161	703.614
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	4.193.727	1.650.933	1.972.149	3.872.511
Action de capitalisation de Catégorie AI	126.324	18.114	45.303	99.135
Action de capitalisation de Catégorie C	690.995	56.174	97.716	649.453
Action de distribution (A) de Catégorie D	622.588	69.873	96.848	595.613
Action de capitalisation de Catégorie D	561.165	299.973	249.244	611.894
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.407.723	449.900	909.214	948.409
Action de capitalisation de Catégorie E	1.827.397	328.286	325.044	1.830.639
Action de capitalisation de Catégorie I	789.180	1.617.085	678.195	1.728.070
Action de capitalisation de Catégorie X	500	-	-	500
US Mid-Cap Value Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	583.405	162.668	221.786	524.287
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	134.830	45.950	77.798	102.982
Action de capitalisation de Catégorie C	37.088	9.859	15.016	31.931
Action de capitalisation de Catégorie D	144.005	82.426	127.213	99.218
Action de capitalisation de Catégorie E	89.870	90.945	107.706	73.109
Action de capitalisation de Catégorie I	1.176	433.073	192.159	242.090
US Sustainable Equity Fund				
Action de capitalisation de Catégorie A	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie D	471	-	-	471
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie E	1.870	17.140	10.044	8.966
Action de capitalisation de Catégorie I	471	-	-	471
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	498.500	-	-	498.500
Action de capitalisation de Catégorie ZI	-	1.003	-	1.003

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
World Energy Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	1.548.699	582.678	1.286.601	844.776
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	434.985	425.429	476.888	383.526
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	291.125	198.344	92.781
Action de capitalisation de Catégorie A	96.028.758	46.731.671	70.647.946	72.112.483
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1.810.780	1.778.761	1.894.385	1.695.156
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	301.458	191.836	119.746	373.548
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	13.940.503	5.467.716	10.184.757	9.223.462
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	8.074.926	6.059.828	10.264.051	3.870.703
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	16.427.907	13.958.138	16.248.494	14.137.551
Action de capitalisation de Catégorie AI	315.497	90.986	209.999	196.484
Action de capitalisation de Catégorie C	2.425.575	403.848	1.588.394	1.241.029
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	1.458.133	285.867	627.967	1.116.033
Action de distribution (A) de Catégorie D	148.117	27.924	90.205	85.836
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	4.553.071	4.292.832	5.008.489	3.837.414
Action de capitalisation de Catégorie D	8.415.986	4.045.360	6.538.941	5.922.405
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	260.209	43.658	77.377	226.490
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	3.176.828	966.417	2.553.593	1.589.652
Action de capitalisation de Catégorie E	8.449.073	2.360.333	5.302.340	5.507.066
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	4.558.451	877.468	2.269.350	3.166.569
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	36.032.432	19.480	36.012.952
Action de capitalisation de Catégorie I	2.914.366	18.190.129	16.122.895	4.981.600
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	4.867.988	5.109.529	2.720.583	7.256.934
Action de capitalisation de Catégorie S	393.377	787.591	745.633	435.335
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	117.968	95.367	123.822	89.513
Action de Catégorie X de distribution (T)	61.872	27.927	89.299	500
Action de capitalisation de Catégorie X	1.187.563	196.210	676.288	707.485
World Financials Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	786.324	310.566	82.341	1.014.549
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	135.375	117.223	18.152
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	422.706	46.684	190.344	279.046
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	6.296.195	961.050	2.123.853	5.133.392
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	27.817.702	9.447.878	15.227.130	22.038.450
Action de capitalisation de Catégorie AI	4.370.273	804.725	1.222.193	3.952.805
Action de capitalisation de Catégorie C	1.612.597	357.445	325.052	1.644.990
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	5.164.775	4.824.935	4.412.272	5.577.438
Action de capitalisation de Catégorie E	8.110.539	1.550.417	1.848.074	7.812.882
Action de capitalisation de Catégorie I	485.560	24.212.055	5.531.563	19.166.052
Action de capitalisation de Catégorie S	-	967	-	967
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	-	465	-	465
Action de Catégorie X de distribution (T)	906.925	223.865	698.268	432.522
Action de capitalisation de Catégorie X	275.146	35.579	103.973	206.752

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
World Gold Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	300.401	106.884	149.411	257.874
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.848.256	435.500	496.884	1.786.872
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	203.817	42.238	161.579
Action de capitalisation de Catégorie A	19.226.696	3.274.773	4.029.559	18.471.910
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	3.133.571	981.953	1.281.004	2.834.520
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1.988.185	629.924	570.934	2.047.175
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	28.373.589	10.359.628	13.934.985	24.798.232
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	9.879.857	12.031.550	10.015.121	11.896.286
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	362.062	87.556	127.054	322.564
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	14.663.541	5.871.843	4.815.157	15.720.227
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	67.300.343	25.841.288	27.598.751	65.542.880
Action de capitalisation de Catégorie AI	154.026	18.235	64.175	108.086
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	91.013	12.029	34.233	68.809
Action de capitalisation de Catégorie C	1.769.385	186.321	441.193	1.514.513
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	3.359.781	764.210	679.238	3.444.753
Action de distribution (A) de Catégorie D	99.778	81.115	76.512	104.381
Action de capitalisation de Catégorie D	8.800.571	2.654.543	4.856.399	6.598.715
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1.560.279	54.107	745.264	869.122
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	6.759.375	5.043.631	5.504.239	6.298.767
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	447.796	165.436	16.089	597.143
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	274.305	388.169	234.873	427.601
Action de capitalisation de Catégorie E	7.840.315	3.934.805	4.673.189	7.101.931
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	13.551.659	3.067.180	4.158.899	12.459.940
Action de capitalisation de Catégorie I	6.113.527	2.504.053	2.322.736	6.294.844
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	830.412	7.125.154	3.596.803	4.358.763
Action de capitalisation de Catégorie S	13.437	-	1.352	12.085
Action de Catégorie X de distribution (T)	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie X	464.661	55.420	254.372	265.709
World Healthscience Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	63.604.256	14.568.428	11.658.668	66.514.016
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	162.613	43.824	118.789
Action de capitalisation de Catégorie A	115.922.160	20.152.935	32.491.989	103.583.106
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	4.513.479	583.278	1.333.441	3.763.316
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	3.332.977	816.621	1.310.832	2.838.766
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1.377.296	213.803	666.314	924.785
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	99.934	50.671	4.329	146.276
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	8.785.510	2.162.724	2.496.449	8.451.785
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	9.693.849	2.729.241	4.231.681	8.191.409
Action de capitalisation de Catégorie AI	3.575.788	1.424.978	1.578.961	3.421.805
Action de capitalisation de Catégorie C	7.506.383	1.320.748	1.395.623	7.431.508
Action de distribution (A) de Catégorie D	3.743.895	734.100	1.394.911	3.083.084
Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	4.500.144	684.511	1.767.251	3.417.404
Action de capitalisation de Catégorie D	23.217.365	7.347.322	11.695.775	18.868.912
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	3.511.784	3.781.820	4.505.063	2.788.541
Action de capitalisation de Catégorie E	40.826.578	5.767.609	9.685.156	36.909.031
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	895.384	882.690	397.923	1.380.151
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	500	-	-	500
Action de capitalisation de Catégorie I	108.974.792	63.669.820	77.980.928	94.663.684
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	3.736.784	977.411	2.319.396	2.394.799
Action de capitalisation de Catégorie S	-	2.688.843	18.507	2.670.336
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	-	829.702	-	829.702
Action de Catégorie X de distribution (T)	637.323	134.925	445.566	326.682
Action de capitalisation de Catégorie X	315.976	928.608	280.375	964.209

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
World Mining Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	1.124.704	190.077	221.188	1.093.593
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	395.289	103.676	153.464	345.501
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	101.943	57.659	44.284
Action de capitalisation de Catégorie A	69.613.826	12.952.256	16.884.386	65.681.696
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	2.868.440	1.504.061	1.396.203	2.976.298
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	933.663	189.488	185.845	937.306
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	18.007.314	3.292.614	6.077.032	15.222.896
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1.663.894	1.210.187	1.721.775	1.152.306
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	6.686.153	4.873.281	6.610.384	4.949.050
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	12.246.404	3.308.773	5.470.941	10.084.236
Action de capitalisation de Catégorie AI	30.249	7.878	13.067	25.060
Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	54.775	5.522	29.906	30.391
Action de capitalisation de Catégorie C	857.737	111.977	199.106	770.608
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	3.919.275	737.328	1.170.791	3.485.812
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1.850.376	781.467	623.789	2.008.054
Action de capitalisation de Catégorie D	4.690.474	1.018.956	2.122.827	3.586.603
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1.108.857	125.036	542.738	691.155
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	5.596.042	1.466.201	2.203.927	4.858.316
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	1.796	-	-	1.796
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	63.688	52.114	27.172	88.630
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	298.537	138.041	163.165	273.413
Action de capitalisation de Catégorie E	5.088.199	1.508.265	2.363.917	4.232.547
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	10.009.454	1.262.780	2.838.659	8.433.575
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	346.840	26.296	320.544
Action de capitalisation de Catégorie I	7.265.711	1.697.355	3.734.711	5.228.355
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	20.329.183	581.323	19.948.215	962.291
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	-	681.843	19.321	662.522
Action de capitalisation de Catégorie S	71.989	69.807	32.276	109.520
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	314.749	322.569	174.580	462.738
Action de Catégorie X de distribution (T)	78.507	21.828	61.187	39.148
Action de capitalisation de Catégorie X	455.875	24.306	208.271	271.910
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	537	-	-	537
World Real Estate Securities Fund				
Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	35.464	21.738	26.881	30.321
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	360.309	56.156	72.288	344.177
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	54.786	2.621	56.909	498
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	39.208	35.276	36.362	38.122
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	6.231	2.101	4.130
Action de capitalisation de Catégorie A	3.980.154	5.679.531	1.030.767	8.628.918
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	-	500	-	500
Action de capitalisation de Catégorie D	1.850.604	1.201.909	1.381.090	1.671.423
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	56.465	-	3.485	52.980
Action de capitalisation de Catégorie E	1.001.566	72.247	176.504	897.309
Action de Catégorie X de distribution (Q)	-	5.544	2	5.542
Action de Catégorie X de distribution (T)	320.775	119.971	244.627	196.119
Action de capitalisation de Catégorie X	2.922.864	456.806	451.728	2.927.942
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	200.314	36.418	40.638	196.094

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Variation du nombre d'actions en circulation

Pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 suite

	Actions en circulation au début de l'exercice	Actions émises	Actions rachetées	Actions en circulation à la clôture de l'exercice
World Technology Fund				
Action de distribution (A) de Catégorie A	610.067	1.025.179	585.924	1.049.322
Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	417	340.591	85.914	255.094
Action de Catégorie A de distribution (T)	-	1.877.964	752.745	1.125.219
Action de capitalisation de Catégorie A	84.641.888	24.528.999	26.252.903	82.917.984
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	4.582.608	3.690.482	3.240.958	5.032.132
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	2.927.985	3.658.750	1.874.184	4.712.551
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	6.099	101.045	2.360	104.784
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	16.364.558	5.698.210	3.623.277	18.439.491
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	2.719.365	1.156.969	1.275.775	2.600.559
Action de capitalisation de Catégorie AI	2.645.527	739.000	1.014.809	2.369.718
Action de capitalisation de Catégorie C	3.938.939	751.867	518.512	4.172.294
Action de capitalisation de Catégorie D	20.342.089	6.954.931	11.116.721	16.180.299
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	921.747	537.580	681.564	777.763
Action de capitalisation de Catégorie E	25.824.106	4.371.323	3.913.431	26.281.998
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	867.895	1.242.503	459.339	1.651.059
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	125.840	-	47.596	78.244
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	173.282	21.320	57.876	136.726
Action de capitalisation de Catégorie I	23.624.496	10.035.702	10.392.068	23.268.130
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	25.670	20.881	13.386	33.165
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	4.260.169	634.278	893.710	4.000.737
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	11.201.730	2.314.492	5.426.240	8.089.982
Action de Catégorie X de distribution (T)	1.017.732	336.782	774.621	579.893
Action de capitalisation de Catégorie X	265.332	87.707	59.360	293.679

Asian Dragon Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Îles Caïmans							
3.614.992	Alibaba	41.575.064	5,30				
42.244	Alibaba	3.918.554	0,50				
1.131.500	Baidu	20.111.126	2,57				
3.162.000	China Mengniu Dairy	10.643.509	1,36				
3.358.666	China Resources Land	14.196.111	1,81				
1.989.500	CK Hutchison	10.844.240	1,38				
1.250.900	ENN Energy	9.808.820	1,25				
746.400	NetEase	15.588.509	1,99				
796.080	Tencent	32.988.238	4,21				
		159.674.171	20,37				
Chine							
426.800	Asymchem Laboratories Tianjin	7.805.222	0,99				
2.251.000	China Merchants Bank	8.897.259	1,14				
2.381.864	China Yangtze Power	7.222.183	0,92				
5.199.000	CMOOC	3.108.935	0,40				
6.596.300	CMOC	5.195.185	0,66				
2.788.200	Haier Smart Home	9.009.953	1,15				
366.100	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock	6.753.023	0,86				
2.251.294	LONGi Green Energy Technology	8.215.665	1,05				
991.600	WuXi AppTec	11.108.109	1,42				
2.179.800	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	8.898.547	1,14				
3.174.000	Zijin Mining	4.993.915	0,64				
2.408.142	Zijin Mining	4.091.161	0,52				
		85.299.157	10,89				
Hong Kong							
2.462.600	AIA	22.355.939	2,85				
4.366.500	BOC Hong Kong	12.136.935	1,55				
1.804.000	Galaxy Entertainment	11.937.762	1,52				
9.972.000	Guangdong Investment	7.794.025	1,00				
1.766.786	Link REIT	8.762.996	1,12				
		62.987.657	8,04				
Inde							
1.730.921	Axis Bank	20.354.243	2,60				
801.770	Cipla	12.179.630	1,55				
477.202	Godrej Properties	9.486.829	1,21				
601.203	HDFC Bank	11.412.044	1,46				
942.769	Infosys	16.346.889	2,09				
746.639	Jio Financial Services	2.105.907	0,27				
2.371.903	Mahindra & Mahindra Financial Services	8.527.948	1,09				
746.639	Reliance Industries	21.708.435	2,77				
1.077.478	SBI Cards & Payment Services	10.627.545	1,35				
		112.749.470	14,39				
Indonésie							
27.012.900	Bank Central Asia	16.273.365	2,08				
35.259.000	Bank Mandiri Persero	13.948.487	1,78				
		30.221.852	3,86				
				Malaisie			
4.393.300	Malayan Banking	8.625.633	1,10				
8.014.700	Public Bank	7.306.499	0,93				
		15.932.132	2,03				
				Singapour			
1.871.400	Oversea-Chinese Banking	17.375.032	2,22				
5.848.900	Singapore Telecommunications	10.298.320	1,31				
		27.673.352	3,53				
				Corée du Sud			
287.650	Hanwha Solutions	7.932.546	1,01				
878.044	Samsung Electronics	44.441.947	5,67				
289.818	Samsung Electronics	11.840.493	1,51				
26.051	Samsung SDI	12.101.618	1,55				
59.127	SK Innovation	7.940.263	1,01				
		84.256.867	10,75				
				Taïwan			
727.000	Accton Technology	10.911.896	1,39				
1.246.000	Delta Electronics	13.537.300	1,73				
111.000	eMemory Technology	6.326.122	0,81				
1.220.420	Hiwin Technologies	7.855.993	1,00				
421.000	Lotes	11.434.999	1,46				
3.522.952	Taiwan Semiconductor Manufacturing	60.731.917	7,75				
569.147	Yageo	8.667.705	1,11				
		119.465.932	15,25				
				Thaïlande			
5.690.900	CP ALL	10.604.158	1,35				
				Royaume-Uni			
770.994	Prudential	9.617.833	1,23				
				États-Unis			
228.239	Air Lease	9.323.563	1,19				
41.944	Albemarle*	8.340.564	1,06				
180.956	Cognizant Technology Solutions	12.972.736	1,66				
		30.636.863	3,91				
		749.119.444	95,60				
				Total des actions ordinaires et privilégiées			
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
		749.119.444	95,60				
				Autres titres négociables			
				ACTIONS ORDINAIRES			
				Hong Kong			
9.828.600	Euro-Asia Agricultural**	-	0,00				
		-	0,00				
		-	0,00				
		749.119.444	95,60				
		34.477.271	4,40				
		783.596.715	100,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Asian Dragon Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	3.504.214	USD	2.281.352	BNY Mellon	15/9/2023	(10.568)
USD	183.401	AUD	283.692	BNY Mellon	15/9/2023	(435)
Moins-value nette non réalisée						(11.003)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	2.495.656	USD	2.857.116	BNY Mellon	15/9/2023	(28.035)
USD	611.916	CHF	536.949	BNY Mellon	15/9/2023	3.233
Moins-value nette non réalisée						(24.802)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	20.800.888	USD	22.813.877	BNY Mellon	15/9/2023	(233.902)
USD	1.931.315	EUR	1.772.005	BNY Mellon	15/9/2023	7.755
Moins-value nette non réalisée						(226.147)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	23.117.716	USD	5.688.466	BNY Mellon	15/9/2023	(79.584)
USD	489.974	PLN	2.009.295	BNY Mellon	15/9/2023	2.471
Moins-value nette non réalisée						(77.113)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	25.762	SGD	34.876	BNY Mellon	5/9/2023	(41)
SGD	110.124.489	USD	81.797.282	BNY Mellon	15/9/2023	(286.179)
USD	6.588.111	SGD	8.914.869	BNY Mellon	15/9/2023	(10.412)
Moins-value nette non réalisée						(296.632)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 124.570.111)						(635.697)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Moins-value non réalisée USD
Singapour			
38.800	Oversea-Chinese Banking	HSBC Bank	(18.062)
			(18.062)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 360.363)			(18.062)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Finance	26,98
Technologie	21,48
Communications	16,83
Biens de consommation non cyclique	7,56
Valeurs industrielles	6,44
Énergie	4,83
Matériaux de base	4,29
Biens de consommation cyclique	4,02
Services aux collectivités	3,17
Autres éléments de l'actif net	4,40
<hr/>	
	100,00

Asian Growth Leaders Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Îles Caïmans							
2.828.600	Alibaba	32.530.978	5,51				
144.254	Alibaba	13.381.001	2,27				
758.650	Baidu	13.484.141	2,28				
2.400.000	China Resources Land	10.144.107	1,72				
1.117.100	ENN Energy	8.759.639	1,48				
594.300	NetEase	12.411.912	2,10				
118.569	Sea	4.525.779	0,77				
1.004.700	Shenzhen International	10.312.200	1,75				
921.400	Tencent	38.181.292	6,47				
		143.731.049	24,35				
Chine							
2.873.216	Haier Smart Home	9.284.679	1,57				
3.432.537	Inner Mongolia Yili Industrial	12.266.893	2,08				
377.809	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock	6.969.005	1,18				
39.800	Kweichow Moutai	10.104.061	1,71				
898.800	WuXi AppTec	10.068.544	1,70				
2.112.593	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	8.624.189	1,46				
6.226.000	Zijin Mining	9.795.877	1,66				
		67.113.248	11,36				
Hong Kong							
3.138.200	AIA	28.489.161	4,82				
1.893.000	Galaxy Entertainment	12.526.710	2,12				
		41.015.871	6,94				
Inde							
4.557.887	Aditya Birla Capital	9.973.409	1,69				
224.014	Cipla	3.402.980	0,58				
1.301.554	Godrej Consumer Products	15.802.828	2,67				
1.280.855	HDFC Bank	24.313.209	4,12				
722.888	ICICI Bank	8.371.787	1,42				
213.359	InterGlobe Aviation	6.275.548	1,06				
1.088.862	PB Fintech	10.188.732	1,72				
273.447	Tata Consultancy Services	11.087.672	1,88				
390.036	Vedant Fashions	5.938.436	1,01				
		95.354.601	16,15				
				Indonésie			
		39.734.400		39.734.400	Bank Central Asia	23.937.170	4,06
		10.493.200		10.493.200	Semen Indonesia Persero	4.685.079	0,79
						28.622.249	4,85
				Philippines			
		1.507.550		1.507.550	Jollibee Foods	6.310.302	1,07
				Singapour			
		1.051.700		1.051.700	Oversea-Chinese Banking	9.764.519	1,65
				Corée du Sud			
		65.678		65.678	Hansol Chemical	8.024.965	1,36
		64.215		64.215	Samsung Electro-Mechanics	6.578.181	1,12
		918.292		918.292	Samsung Electronics	46.479.088	7,87
		43.983		43.983	SK Innovation	5.906.550	1,00
						66.988.784	11,35
				Taïwan			
		711.000		711.000	Accton Technology	10.671.745	1,81
		1.042.000		1.042.000	Delta Electronics	11.320.920	1,92
		89.000		89.000	eMemory Technology	5.072.296	0,86
		3.125.000		3.125.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	53.871.651	9,12
						80.936.612	13,71
				Thaïlande			
		7.649.400		7.649.400	CP ALL	14.253.535	2,41
				Royaume-Uni			
		448.450		448.450	Prudential	5.594.229	0,95
				États-Unis			
		145.598		145.598	Air Lease	5.947.678	1,01
		39.097		39.097	Albemarle*	7.774.438	1,31
		120.127		120.127	Cognizant Technology Solutions	8.611.905	1,46
						22.334.021	3,78
				Total des actions ordinaires		582.019.020	98,57
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		582.019.020	98,57
				Total du portefeuille		582.019.020	98,57
				Autres éléments de l'actif net		8.470.069	1,43
				Total de l'actif net (USD)		590.489.089	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Asian Growth Leaders Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	12.292.267	USD	8.003.705	BNY Mellon	15/9/2023	(38.130)
USD	641.836	AUD	993.307	BNY Mellon	15/9/2023	(1.840)
Moins-value nette non réalisée						(39.970)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	16.603.900	USD	19.007.833	BNY Mellon	15/9/2023	(185.618)
USD	1.686.908	CHF	1.479.968	BNY Mellon	15/9/2023	9.221
Moins-value nette non réalisée						(176.397)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	20.094.976	USD	22.039.493	BNY Mellon	15/9/2023	(225.812)
USD	1.862.507	EUR	1.708.653	BNY Mellon	15/9/2023	7.722
Moins-value nette non réalisée						(218.090)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	3.006.808	USD	3.824.946	BNY Mellon	15/9/2023	(13.176)
USD	325.598	GBP	256.391	BNY Mellon	15/9/2023	570
Moins-value nette non réalisée						(12.606)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	27.367.633	USD	20.327.861	BNY Mellon	15/9/2023	(71.096)
USD	1.691.356	SGD	2.288.544	BNY Mellon	15/9/2023	(2.556)
Moins-value nette non réalisée						(73.652)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 78.813.339)						(520.715)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Technologie	25,01
Finance	21,44
Communications	19,11
Biens de consommation cyclique	10,99
Biens de consommation non cyclique	9,92
Valeurs industrielles	5,29
Matériaux de base	4,33
Services aux collectivités	1,48
Énergie	1,00
Autres éléments de l'actif net	1,43
	100,00

Asian High Yield Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 3.348.000	Huarong Finance 2019 3,375% 24/2/2030*	2.444.040	0,16
COMPARTIMENTS				USD 1.669.000	Huarong Finance 2019 3,625% 30/9/2030*	1.218.236	0,08
Singapour				USD 2.312.000	Huarong Finance 2019 3,875% 13/11/2029	1.693.540	0,11
5.890.677	iShares USD Asia High Yield Bond Index ETF*-	34.990.622	2,31	USD 6.300.000	Huarong Finance 2019 4,25% 30/9/2025*	5.032.787	0,33
Total des Compartiments		34.990.622	2,31	USD 3.169.000	Huarong Finance 2019 4,5% 29/5/2029	2.346.724	0,16
OBLIGATIONS				USD 3.619.000	LS Finance 2017 4,8% 18/6/2026*	2.579.677	0,17
Bermudes				USD 3.131.000	LS Finance 2025 4,5% 26/6/2025*	2.459.416	0,16
USD 8.896.000	China Oil & Gas 4,7% 30/6/2026*	7.450.845	0,49	USD 6.641.000	New Metro Global 4,5% 2/5/2026	1.798.184	0,12
USD 5.400.000	China Water Affairs 4,85% 18/5/2026*	4.740.039	0,31	USD 5.122.000	New Metro Global 4,625% 15/10/2025	1.523.974	0,10
USD 3.183.000	Luye Pharma 6,25% 6/7/2028	2.859.410	0,19	USD 6.256.000	New Metro Global 4,8% 15/12/2024	2.461.611	0,16
		15.050.294	0,99	USD 8.435.000	NWD Finance BVI 4,125% 10/3/2028	4.191.309	0,28
Îles Vierges britanniques				USD 8.360.000	NWD Finance BVI 5,25% 22/3/2026	5.061.771	0,33
USD 1.125.000	Central Plaza Development 3,85% 14/7/2025	864.366	0,06	USD 2.709.000	NWD Finance BVI 6,15% 16/3/2025*	1.902.869	0,13
USD 4.600.000	Central Plaza Development 5,75% 14/11/2024*	3.541.448	0,23	USD 8.663.000	NWD MTN 4,125% 18/7/2029	5.620.424	0,37
USD 5.407.000	Champion Path 4,5% 27/1/2026*	4.791.062	0,32	USD 3.054.000	NWD MTN 4,5% 19/5/2030	1.952.819	0,13
USD 5.407.000	Champion Path 4,85% 27/1/2028	4.358.988	0,29	USD 7.560.000	Peak RE Bvi 5,35% 28/10/2025	6.333.692	0,42
USD 16.950.000	China Cinda 2020 I Management 5,75% 7/2/2027*	16.678.292	1,10	USD 3.138.000	RKPF Overseas 2019 A 5,9% 5/3/2025*	1.761.877	0,12
USD 558.936	Easy Tactic 7,5% 11/7/2025	39.005	0,00	USD 3.832.000	RKPF Overseas 2019 A 6% 4/9/2025*	1.781.880	0,12
USD 2.639.000	Elect Global Investments 4,1% 3/6/2025	2.146.338	0,14	USD 4.771.000	RKPF Overseas 2019 A 6,7% 30/9/2024*	3.188.340	0,21
USD 8.098.000	ENN Clean Energy International Investment 3,375% 12/5/2026	7.442.548	0,49	USD 5.311.000	RKPF Overseas 2020 A 5,125% 26/7/2026	1.722.304	0,11
USD 10.205.000	Estate Sky 5,45% 21/7/2025	9.030.455	0,60	USD 5.597.000	RKPF Overseas 2020 A 5,2% 12/1/2026	2.053.092	0,14
USD 3.073.000	Expand Lead 4,95% 22/7/2026*	2.776.394	0,18	USD 5.005.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance I 6% 30/7/2024	600.600	0,04
HKD 48.000.000	Farsail Goldman International 7% 24/11/2026	1.683.034	0,11	USD 13.267.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance II 5,95% 4/2/2027*	1.194.030	0,08
EUR 17.300.000	Fortune Star BVI 3,95% 2/10/2026	11.628.113	0,77	USD 2.000.000	Sino-Ocean Land Treasure III 6,946% 21/9/2027	37.560	0,00
USD 9.229.000	Fortune Star BVI 5% 18/5/2026*	6.115.136	0,40	USD 10.850.000	Sino-Ocean Land Treasure IV 2,7% 13/1/2025	1.305.526	0,09
USD 5.254.000	Fortune Star BVI 5,05% 27/1/2027	3.362.875	0,22	USD 4.451.000	Sino-Ocean Land Treasure IV 3,25% 5/5/2026	538.193	0,04
USD 7.243.000	Fortune Star BVI 5,95% 19/10/2025*	5.691.549	0,38	USD 6.676.000	Sino-Ocean Land Treasure IV 4,75% 5/8/2029	534.080	0,04
USD 2.770.000	Franshion Brilliant 3,2% 9/4/2026*	2.178.951	0,14	USD 4.451.000	Sino-Ocean Land Treasure IV 4,75% 14/1/2030	356.080	0,02
USD 3.176.000	Franshion Brilliant 4,25% 23/7/2029	2.084.409	0,14	HKD 22.000.000	Smart Insight International 4,5% 5/12/2023	431.979	0,03
USD 3.500.000	Fuqing Investment Management 3,25% 23/6/2025	2.476.250	0,16	USD 11.321.200	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033*	11.042.586	0,73
USD 4.000.000	Hejun Shunze Investment 8,85% 10/1/2022***	80.000	0,01	USD 3.792.000	Studio City 7% 15/2/2027*	3.599.954	0,24
USD 3.300.000	Huantaihu International Investment 7,3% 16/2/2026	3.283.500	0,22	USD 12.101.000	Studio City Finance 5% 15/1/2029	9.104.248	0,60
SGD 26.500.000	Huarong Finance 2017 3,8% 7/11/2025	16.590.513	1,10	USD 5.607.000	Studio City Finance 6% 15/7/2025*	5.282.271	0,35
USD 5.240.000	Huarong Finance 2017 4,25% 7/11/2027	3.961.702	0,26	USD 5.607.000	Studio City Finance 6,5% 15/1/2028*	4.698.302	0,31
USD 4.400.000	Huarong Finance 2017 4,75% 27/4/2027	3.458.818	0,23	USD 6.000.000	Sun Hung Kai & BVI 5% 7/9/2026	5.100.000	0,34
USD 1.700.000	Huarong Finance 2017 4,95% 7/11/2047*	1.090.865	0,07	USD 4.606.000	Wanda Properties Global 11% 13/2/2026	1.806.703	0,12
						220.115.289	14,56

* Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Îles Caïmans				USD 8.863.000	Longfor 3,95% 16/9/2029	5.257.133	0,35
USD 3.720.000	AC Energy Finance International 5,1% 25/11/2025	2.881.698	0,19	USD 1.954.000	Longfor 4,5% 16/1/2028*	1.277.945	0,08
USD 4.869.000	ACEN Finance 4% 8/3/2025	3.341.035	0,22	USD 8.645.000	Melco Resorts Finance 4,875% 6/6/2025	8.210.027	0,54
USD 3.215.000	Agile 5,5% 21/4/2025	401.875	0,03	USD 4.310.000	Melco Resorts Finance 5,25% 26/4/2026	4.008.300	0,26
USD 2.400.000	Agile 5,5% 17/5/2026	242.916	0,02	USD 12.144.000	Melco Resorts Finance 5,375% 4/12/2029	10.170.721	0,67
USD 5.233.000	Agile 5,75% 2/1/2025	775.217	0,05	USD 10.570.000	Melco Resorts Finance 5,625% 17/7/2027*	9.535.038	0,63
USD 4.887.000	Agile 6,05% 13/10/2025	562.005	0,04	USD 13.080.000	Melco Resorts Finance 5,75% 21/7/2028*	11.603.333	0,77
USD 5.750.000	Agile 13,476% 2/10/2023*	324.702	0,02	USD 10.480.000	MGM China 4,75% 1/2/2027*	9.474.863	0,63
USD 7.330.000	AYC Finance 3,9% 23/9/2026*	4.687.535	0,31	USD 5.215.000	MGM China 5,25% 18/6/2025*	5.017.273	0,33
HKD 22.000.000	Cathay Pacific Finance III 2,75% 5/2/2026	2.945.955	0,19	USD 11.063.000	MGM China 5,875% 15/5/2026*	10.591.550	0,70
USD 9.173.000	China Aoyuan 5,375% 13/9/2022***	275.190	0,02	USD 4.988.000	New World China Land 4,75% 23/1/2027	3.700.896	0,24
USD 4.087.000	China Aoyuan 7,95% 19/2/2023***	122.610	0,01	USD 7.421.000	PCGI Intermediate III 4,5% 23/8/2026	6.159.430	0,41
USD 1.402.000	China Aoyuan 7,95% 21/6/2024***	42.060	0,00	USD 9.000.000	PCPD Capital 5,125% 18/6/2026*	6.660.900	0,44
USD 3.992.000	China SCE 5,95% 29/9/2024	429.140	0,03	USD 1.839.862	Pearl II 6% 2/10/2023	50.615	0,00
USD 9.300.000	China SCE 6% 4/2/2026	800.683	0,05	USD 1.465.280	Pearl III 9% 22/10/2025	456.061	0,03
USD 5.862.000	China SCE 7% 2/5/2025	532.152	0,04	USD 3.317.000	PineBridge Investments 6% 12/9/2024*	3.134.565	0,21
USD 7.199.000	Country Garden 2,7% 12/7/2026	629.912	0,04	USD 1.000.000	QNB Finance 3,15% 4/2/2026	135.704	0,01
USD 10.243.000	Country Garden 3,125% 22/10/2025*	921.870	0,06	USD 4.180.000	Sands China 2,8% 8/3/2027	3.625.481	0,23
USD 6.614.000	Country Garden 3,3% 12/1/2031	529.120	0,04	USD 4.330.000	Sands China 3,35% 8/3/2029*	3.595.004	0,24
USD 4.543.000	Country Garden 3,875% 22/10/2030	362.032	0,02	USD 4.427.000	Sands China 3,5% 8/8/2031	3.544.610	0,24
USD 4.797.000	Country Garden 4,2% 6/2/2026	417.291	0,03	USD 7.045.000	Sands China 4,3% 8/1/2026	6.599.756	0,44
USD 5.387.000	Country Garden 4,8% 6/8/2030	430.960	0,03	USD 3.940.000	Sands China 4,875% 18/6/2030*	3.443.284	0,23
USD 7.814.000	Country Garden 5,125% 17/1/2025	785.307	0,05	USD 2.940.000	Sands China 5,375% 8/8/2025	2.847.228	0,19
USD 6.295.000	Country Garden 5,125% 14/1/2027	518.362	0,03	USD 12.767.000	Sands China 5,65% 8/8/2028	12.023.642	0,79
USD 5.701.000	Country Garden 5,4% 27/5/2025	517.138	0,03	USD 4.550.000	Seazen 4,45% 13/7/2025	1.418.644	0,09
USD 3.607.000	Country Garden 5,625% 15/12/2026	315.667	0,02	USD 2.873.000	Seazen 6% 12/8/2024*	1.522.690	0,10
USD 5.121.000	Country Garden 5,625% 14/1/2030	410.858	0,03	USD 2.499.000	Shui On Development 5,5% 3/3/2025	1.312.775	0,09
USD 5.227.000	Country Garden 6,15% 17/9/2025	468.104	0,03	USD 2.921.000	Shui On Development 5,5% 29/6/2026	1.329.055	0,09
USD 12.377.000	Country Garden 7,25% 8/4/2026*	1.082.987	0,07	USD 3.468.000	Shui On Development 6,15% 24/8/2024*	2.316.589	0,15
USD 3.088.000	eHi Car Services 7% 21/9/2026	1.721.637	0,11	USD 4.028.000	Sunac China 5,95% 26/4/2024***	443.080	0,03
USD 4.632.000	eHi Car Services 7,75% 14/11/2024	3.468.511	0,23	USD 5.113.000	Sunac China 6,5% 9/7/2023***	562.430	0,04
SGD 1.250.000	ESR 5,1% 26/2/2025	897.976	0,06	USD 3.894.000	Sunac China 6,65% 3/8/2024	428.340	0,03
SGD 4.500.000	ESR 5,65% 2/3/2026*	3.230.524	0,21	USD 2.153.000	Sunac China 6,8% 20/10/2024***	236.830	0,02
USD 4.000.000	Fantasia 6,95% 17/12/2021***	224.660	0,01	USD 1.003.000	Sunac China 7,5% 1/2/2024	110.330	0,01
USD 5.000.000	Fantasia 7,95% 5/7/2022***	239.700	0,01	USD 1.000.000	Sunac China 7,95% 8/8/2022***	110.000	0,01
USD 5.600.000	Fantasia 9,25% 28/7/2023***	280.000	0,02	USD 3.500.000	Sunac China 7,95% 11/10/2023***	385.000	0,03
USD 9.860.000	Fantasia 9,875% 19/10/2023	493.000	0,03	USD 5.820.000	Times China 5,55% 4/6/2024***	261.900	0,02
USD 3.400.000	Fantasia 10,875% 2/3/2024	170.000	0,01	USD 1.115.000	Times China 6,2% 22/3/2026***	50.175	0,00
USD 4.500.000	Fantasia 11,75% 17/4/2022***	225.000	0,01	USD 2.102.000	Times China 6,6% 2/3/2023***	94.590	0,01
USD 6.440.000	Fantasia 11,875% 1/6/2023***	322.000	0,02	USD 3.868.000	Times China 6,75% 16/7/2023***	174.060	0,01
USD 5.800.000	Fantasia 12,25% 18/10/2022***	290.000	0,02	USD 5.270.000	Times China 6,75% 8/7/2025***	237.150	0,02
USD 4.500.000	FWD 5,75% 9/7/2024	4.400.438	0,29	USD 3.087.000	Vnet 0% 1/2/2026	2.415.578	0,16
USD 1.800.000	FWD 6,375% 13/9/2024*	1.552.833	0,10	USD 4.458.000	Wynn Macau 4,875% 1/10/2024*	4.346.260	0,29
USD 7.822.000	FWD 8,045% 15/12/2023	7.175.512	0,47	USD 12.300.000	Wynn Macau 5,125% 15/12/2029*	10.077.575	0,66
USD 6.346.000	Greentown China 4,7% 29/4/2025*	5.126.172	0,34	USD 9.682.000	Wynn Macau 5,5% 15/1/2026*	9.087.574	0,60
USD 4.843.000	Greentown China 5,65% 13/7/2025*	3.910.722	0,26	USD 11.015.000	Wynn Macau 5,5% 1/10/2027	9.878.252	0,65
USD 4.048.000	Longfor 3,375% 13/4/2027*	2.711.614	0,18	USD 16.122.000	Wynn Macau 5,625% 26/8/2028*	14.162.452	0,93
USD 5.449.000	Longfor 3,85% 13/1/2032	2.966.572	0,20			257.245.940	16,98

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Chine				USD 11.818.000	ZhongAn Online P&C Insurance 3,5% 8/3/2026	10.070.177	0,66
CNY 50.000.000	Bank of Beijing 2,75% 26/6/2026	6.880.559	0,45	CNY 50.000.000	Zijin Mining 3,67% 21/6/2030	6.896.669	0,45
CNY 10.000.000	Bank of Beijing 3,38% 23/4/2024	1.381.769	0,09	116.062.682 7,64			
USD 3.000.000	Bank of China 3,6% 4/3/2025	2.883.285	0,19	Hong Kong			
USD 1.000.000	Bank of Communications 3,8% 18/11/2025	950.750	0,06	USD 3.068.000	Bank of Communications Hong Kong 3,725% 3/3/2025	2.949.928	0,20
CNY 10.000.000	Beijing Capital Development 3,74% 12/4/2028	1.370.806	0,09	USD 15.053.000	Bank of East Asia 5,825% 21/10/2025	11.626.109	0,77
CNY 10.000.000	Beijing Capital Development 3,76% 22/9/2027	1.378.614	0,09	USD 3.128.000	Bank of East Asia 5,875% 19/9/2024*	2.598.633	0,17
CNY 10.000.000	Beijing Capital Development 4,4% 10/3/2026	1.395.595	0,09	USD 11.469.000	Chong Hing Bank 5,5% 3/8/2025*	10.825.704	0,72
CNY 30.000.000	CCB Life Insurance 4,3% 1/2/2031	4.244.480	0,28	USD 3.352.000	Gemdale Ever Prosperity Investment 4,95% 12/8/2024*	1.172.328	0,08
CNY 20.000.000	Change Economic Construction Investment 4,3% 28/6/2028	2.794.807	0,19	USD 5.171.000	Lai Sun MTN 5% 28/7/2026	2.941.653	0,19
CNY 30.000.000	China Datang 3,1% 26/7/2026	4.130.232	0,28	USD 4.300.000	Nanyang Commercial Bank 3,8% 20/11/2029	4.130.666	0,27
CNY 10.000.000	China Development Bank 2,73% 11/11/2024	1.381.549	0,09	USD 5.685.000	Nanyang Commercial Bank 6,5% 28/4/2027	5.493.387	0,36
CNY 12.000.000	China Development Bank 3,12% 13/9/2031	1.688.712	0,11	USD 4.750.000	Nanyang Commercial Bank 7,35% 7/3/2028	4.623.678	0,31
CNY 100.000	China Development Bank 3,23% 10/1/2025	13.906	0,00	USD 2.500.000	Pingan Real Estate Capital 2,75% 29/7/2024*	2.000.000	0,13
CNY 12.000.000	China Development Bank 3,41% 7/6/2031	1.720.959	0,12	USD 886.000	Shanghai Hong Kong International Investments 5% 16/6/2025	823.590	0,06
CNY 50.000	China Galaxy 0,4% 24/3/2028	8.951	0,00	CNH 57.000.000	Swire Properties MTN Financing 3,3% 25/7/2025	7.848.730	0,52
CNY 10.000.000	China Huadian 3,25% 21/6/2026	1.382.271	0,09	USD 10.329.000	Yanlord Land HK 5,125% 20/5/2026*	5.913.353	0,39
CNY 30.000.000	China Resources Asset Management 3,05% 21/6/2026	4.104.676	0,27	62.947.759 4,17			
USD 1.068.000	Gansu Provincial Highway Aviation Tourism Investment 3,25% 3/11/2023*	1.056.209	0,07	Inde			
CNY 30.000.000	Huai An Traffic 4% 19/8/2027	4.077.082	0,27	USD 13.057.000	Adani Green Energy 4,375% 8/9/2024*	12.214.562	0,80
CNY 50.000.000	Huaxia Bank 2,7% 30/5/2026	6.875.166	0,45	USD 9.306.000	Adani Green Energy UP / Prayatna Developers Pvt / Parampujya Solar Energ 6,25% 10/12/2024	8.838.606	0,58
USD 3.216.000	Industrial & Commercial Bank of China 3,2% 24/9/2026	2.961.261	0,20	USD 3.186.200	Adani Renewable Energy RJ/ Kodangal Solar Parks Pvt/ Wardha Solar Maharash 4,625% 15/10/2039	2.344.661	0,15
USD 3.048.000	Industrial & Commercial Bank of China 3,58% 23/9/2025	2.896.667	0,19	USD 5.975.000	Axis Bank 4,1% 8/9/2026*	5.211.126	0,34
USD 2.000.000	Kunming Rail Transit 8,5% 7/12/2025	1.648.981	0,11	USD 5.815.000	Delhi International Airport 6,125% 31/10/2026	5.691.431	0,38
CNY 30.000.000	Luneng 3,15% 13/7/2025	4.132.508	0,27	USD 11.550.000	Delhi International Airport 6,45% 4/6/2029*	10.887.434	0,72
CNH 16.000.000	Pharmaron Beijing 0% 18/6/2026	2.163.997	0,14	USD 15.687.000	GMR Hyderabad International Airport 4,25% 27/10/2027*	14.008.413	0,92
USD 1.900.000	Pharmaron Beijing 0% 18/6/2026	1.755.125	0,12	USD 3.192.000	GMR Hyderabad International Airport 4,75% 2/2/2026*	3.047.131	0,20
CNY 50.000.000	Ping An Bank 2,77% 12/4/2026	6.888.248	0,45	USD 15.771.000	HDFC Bank 3,7% 25/8/2026*	13.704.999	0,91
CNY 10.000.000	Shudao Investments 2,99% 31/10/2025	1.371.014	0,09	USD 12.037.200	JSW Hydro Energy 4,125% 18/5/2031*	10.159.637	0,67
CNY 10.000.000	Shudao Investments 3,01% 7/11/2025	1.374.281	0,09	USD 11.386.000	JSW Infrastructure 4,95% 21/1/2029*	9.991.784	0,66
CNY 50.000.000	Shudao Investments 3,04% 12/10/2025	6.878.871	0,45	USD 5.753.000	JSW Steel 3,95% 5/4/2027*	5.080.963	0,33
CNY 10.000.000	Shudao Investments 3,5% 16/11/2025	1.380.311	0,09	USD 800.000	JSW Steel 3,95% 5/4/2027*	706.548	0,05
CNY 20.000.000	State Power Investment 3,19% 1/8/2026	2.760.986	0,18	USD 7.358.000	JSW Steel 5,05% 5/4/2032*	5.998.021	0,40
USD 5.400.000	Sunshine Life Insurance 4,5% 20/4/2026	4.810.077	0,32	USD 2.620.000	Muthoot Finance 4,4% 2/9/2023	2.619.738	0,17
CNY 30.000.000	Syngenta 2,65% 21/9/2025	4.119.792	0,27	USD 2.690.000	ReNew Pvt 5,875% 5/3/2027*	2.518.095	0,17
USD 2.000.000	Tianjin Rail Transit Urban Development 6,2% 25/9/2023	1.995.000	0,13	USD 5.849.000	ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt other 9 Subsidiaries 4,5% 14/7/2028*	4.956.677	0,33
USD 2.550.000	ZhongAn Online P&C Insurance 3,125% 16/7/2025	2.238.339	0,15				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 4.271.000	Shriram Finance 4,15% 18/7/2025*	4.042.139	0,27	USD 12.611.040	Pays-Bas Greenko Dutch 3,85% 29/3/2026	11.415.766	0,76
		122.021.965	8,05	USD 3.032.000	ICTSI Treasury 3,5% 16/11/2031	2.611.067	0,17
	Indonésie			USD 15.718.000	Mong Duong Finance 5,125% 7/5/2029	14.253.082	0,94
USD 2.434.000	Bank Negara Indonesia Persero 3,75% 30/3/2026	2.266.845	0,15	USD 3.882.000	Royal Capital 4,875% 5/5/2024	3.824.411	0,25
USD 16.249.000	Bank Negara Indonesia Persero 4,3% 24/3/2027	13.462.378	0,89	USD 7.249.000	Royal Capital 5% 5/2/2026	7.054.364	0,47
USD 6.660.000	Bank Tabungan Negara Persero 4,2% 23/1/2025	6.328.332	0,42			39.158.690	2,59
USD 5.300.000	Japfa Comfeed Indonesia 5,375% 23/3/2026*	4.294.007	0,28		Pakistan		
USD 15.140.000	Pakuwon Jati 4,875% 29/4/2028*	13.690.420	0,90	USD 2.000.000	Pakistan Government International Bond 6% 8/4/2026*	1.045.400	0,07
USD 2.124.000	Saka Energi Indonesia 4,45% 5/5/2024*	2.089.400	0,14	USD 4.000.000	Pakistan Government International Bond 8,25% 30/9/2025	2.473.480	0,16
		42.131.382	2,78	USD 7.914.000	Pakistan Water & Power Development Authority 7,5% 4/6/2031	3.521.730	0,23
	Japon					7.040.610	0,46
USD 4.000.000	Nissan Motor 3,522% 17/9/2025	3.784.339	0,25		Philippines		
USD 10.800.000	Nissan Motor 4,81% 17/9/2030	9.534.883	0,63	USD 14.245.000	Globe Telecom 4,2% 2/8/2026	13.304.047	0,88
JPY 500.000.000	Rakuten 1,3% 2/12/2033	1.926.756	0,13	USD 3.775.000	Manila Water 4,375% 30/7/2030	3.488.477	0,23
JPY 600.000.000	Rakuten 1,5% 2/12/2036	2.058.650	0,14	USD 6.136.000	Petron 5,95% 19/4/2026	5.637.419	0,37
USD 14.371.000	Rakuten 3,546% 27/11/2024*	13.311.139	0,88	USD 10.624.000	Rizal Commercial Banking 6,5% 27/8/2025	9.732.009	0,64
EUR 1.800.000	Rakuten 4,25% 22/4/2027	936.055	0,06	USD 5.009.000	San Miguel 5,5% 29/7/2025	4.608.280	0,31
EUR 10.000.000	SoftBank 2,875% 6/1/2027*	9.645.760	0,64	USD 8.068.000	SMC Global Power 5,45% 9/12/2026	5.607.260	0,37
EUR 750.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032	637.497	0,04	USD 9.080.000	SMC Global Power 5,7% 21/1/2026	6.631.215	0,44
USD 3.631.000	SoftBank 4% 6/7/2026*	3.326.904	0,22	USD 2.500.000	SMC Global Power 5,95% 5/5/2025	1.915.150	0,13
EUR 3.308.000	SoftBank 5% 15/4/2028*	3.387.620	0,22	USD 6.262.000	SMC Global Power 7% 21/10/2025	5.074.975	0,33
		48.549.603	3,21			55.998.832	3,70
	Maurice				Singapour		
USD 8.982.282	Azure Power Energy 3,575% 19/8/2026*	7.109.611	0,47	SGD 5.000.000	Ascott REIT MTN 4,2% 6/9/2028	3.725.844	0,25
USD 7.274.000	Azure Power Solar Energy Pvt 5,65% 24/12/2024*	6.394.574	0,42	SGD 2.750.000	City Developments 3,9% 21/3/2024	2.029.469	0,13
USD 22.602.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	20.302.020	1,34	SGD 1.500.000	CMT MTN 2,1% 8/3/2028	1.023.423	0,07
USD 5.136.390	Clean Renewable Power Mauritius 4,25% 25/3/2027*	4.483.041	0,30	USD 3.293.000	Continuum Energy Aura 9,5% 24/2/2027	3.297.116	0,22
USD 4.327.000	Diamond II 7,95% 28/7/2026	4.262.736	0,28	USD 7.295.773	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027	6.812.428	0,45
USD 13.094.445	Greenko Power II 4,3% 13/12/2028*	11.384.575	0,75	SGD 1.000.000	GLL IHT 3,29% 26/10/2026	718.018	0,05
USD 4.552.000	Greenko Solar Mauritius 5,55% 29/1/2025	4.414.689	0,29	SGD 7.000.000	GLL IHT 4,4% 27/7/2028	5.188.632	0,34
USD 6.549.000	Greenko Solar Mauritius 5,95% 29/7/2026	6.172.269	0,41	SGD 2.500.000	GLL IHT 4,6% 23/1/2024	1.814.835	0,12
USD 6.841.000	Greenko Wind Projects Mauritius 5,5% 6/4/2025	6.596.366	0,43	USD 9.648.000	Global Prime Capital 5,95% 23/1/2025	9.368.690	0,62
USD 11.536.000	India Airport Infra 6,25% 25/10/2025	11.301.761	0,74	USD 9.187.000	GLP 4,5% 17/5/2026	2.969.836	0,20
USD 15.786.000	India Clean Energy 4,5% 18/4/2027*	13.357.245	0,88	USD 3.243.000	GLP 4,6% 29/6/2027	1.027.544	0,07
USD 2.873.884	India Cleantech Energy 4,7% 10/8/2026	2.507.837	0,17	USD 450.065	JGC Ventures 0% 30/6/2025	90.486	0,01
USD 4.593.000	India Green Power 4% 22/2/2027	4.068.663	0,27	USD 7.081.119	JGC Ventures 3% 30/6/2025	2.124.336	0,14
USD 5.407.000	Network i2i 3,975% 3/3/2026*	4.963.599	0,33	USD 12.837.000	Jollibee Worldwide 3,9% 23/1/2025	12.291.428	0,81
USD 10.814.000	Network i2i 5,65% 15/1/2025	10.526.510	0,69	SGD 1.000.000	Jurong Shipyard 3,85% 10/9/2029	707.472	0,05
USD 3.219.000	UPL 5,25% 27/2/2025*	2.523.616	0,17	SGD 1.750.000	Keppel 3% 7/5/2024	1.282.360	0,08
		120.369.112	7,94	SGD 3.000.000	Keppel Infrastructure Trust 3% 1/12/2026	2.128.115	0,14
	Mongolie			USD 600.000	LMIRT Capital 7,25% 19/6/2024	375.000	0,02
USD 8.576.000	Mongolia Government International Bond 3,5% 7/7/2027	7.205.212	0,48	USD 2.052.000	LMIRT Capital 7,5% 9/2/2026	1.150.187	0,08
USD 4.361.000	Mongolian Mining/Energy Resources 9,25% 15/4/2024*	4.302.214	0,28				
		11.507.426	0,76				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
SGD 1.000.000	Mapletree North Asia Commercial Trust 3,5% 8/6/2026	663.761	0,04	USD 10.795.000	Vedanta Resources 6,125% 9/8/2024*	6.471.819	0,43
SGD 2.250.000	Mapletree Treasury Services 2,85% 29/8/2025	1.623.943	0,11	USD 29.969.000	Vedanta Resources Finance II 8,95% 11/3/2025	19.658.166	1,30
USD 11.680.000	Medco Bell 6,375% 30/1/2027*	10.861.901	0,72			41.655.947	2,75
USD 12.043.000	Medco Laurel Tree 6,95% 12/11/2028*	10.966.476	0,72	États-Unis			
USD 5.311.000	Medco Oak Tree 7,375% 14/5/2026	5.219.120	0,34	USD 3.345.000	Nissan Motor Acceptance 2% 9/3/2026	2.977.923	0,20
USD 311.370	Modernland Overseas 3% 30/4/2027	84.045	0,00	USD 12.400.000	Nissan Motor Acceptance 2,45% 15/9/2028	10.095.784	0,67
USD 7.477.186	Modernland Overseas 4% 30/4/2027	2.243.156	0,15	USD 10.366.000	Periama 5,95% 19/4/2026*	9.886.676	0,65
SGD 1.500.000	Olam 5,375% 18/7/2026	1.067.686	0,07	USD 5.400.000	Resorts World Las Vegas / RWLV Capital 4,625% 16/4/2029	4.424.220	0,29
SGD 1.000.000	OUE Treasury 3,5% 21/9/2026	693.050	0,04			27.384.603	1,81
SGD 3.750.000	Oversea-Chinese Banking 4,5% 15/2/2029	2.808.934	0,18	Vietnam			
SGD 2.000.000	Sembcorp Financial Services 3,593% 26/11/2026	1.453.714	0,10	USD 8.451.000	BIM Land JSC 7,375% 7/5/2026	6.014.535	0,40
SGD 9.500.000	Shangri-La Hotel 4,4% 1/8/2028	7.050.886	0,47	USD 2.000.000	Vingroup JSC 3% 20/4/2026	1.859.720	0,12
SGD 500.000	Singapore Airlines 3,75% 8/4/2024	368.976	0,02	USD 6.600.000	Vinpearl JSC 3,25% 21/9/2026	5.791.500	0,38
SGD 500.000	Singapore Technologies Telemedia 4,1% 2/7/2027	357.100	0,02			13.665.755	0,90
SGD 2.500.000	Singapore Technologies Telemedia 4,2% 3/5/2029	1.768.986	0,12	Total des obligations		1.392.906.052	91,95
SGD 2.000.000	Singapore Technologies Telemedia 5% 17/1/2024	1.471.517	0,10	BILLET DE TRÉSORERIE			
SGD 10.000.000	Singapore Technologies Telemedia 5,5% 11/7/2030	7.481.558	0,49	Chine			
SGD 1.000.000	SingPost Treasury 4,35% 6/4/2027	715.871	0,05	CNY 50.000.000	Tianjin Infrastructure Construction & Investment 6,35% 18/1/2024	6.949.037	0,46
SGD 11.250.000	Straits Trading 3,25% 13/2/2028	7.323.994	0,48	Total des billets de trésorerie		6.949.037	0,46
SGD 2.000.000	STT GDC 3,59% 26/9/2024	1.467.829	0,10	CERTIFICATS DE DÉPÔT			
USD 4.381.000	Theta Capital 8,125% 22/1/2025	3.537.833	0,23	Chine			
SGD 1.000.000	Thomson Medical 4,05% 28/1/2025	736.103	0,05	CNY 30.000.000	Bank of Communications 0% 8/11/2023	4.102.282	0,27
USD 16.234.000	TML 4,35% 9/6/2026	14.980.898	0,99	CNY 30.000.000	China Construction Bank 0% 17/11/2023	4.100.220	0,27
SGD 3.000.000	Vertex Venture 3,3% 28/7/2028	2.093.309	0,14	CNY 30.000.000	China Everbright Bank 0% 30/11/2023	4.095.281	0,27
		145.165.865	9,58	CNY 30.000.000	China Merchants Bank 0% 10/11/2023	4.100.553	0,27
				CNY 30.000.000	Industrial Bank 0% 6/11/2023	4.100.544	0,27
				CNY 30.000.000	Shanghai Pudong Development Bank 0% 17/11/2023	4.098.508	0,27
				Total des certificats de dépôt		24.597.388	1,62
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
						1.459.443.099	96,34
				Autres titres négociables			
				OBLIGATIONS			
				Îles Vierges britanniques			
				USD 2	Easy Tactic 7,5% 11/7/2028	-	0,00
				Îles Caïmans			
				USD 3	Modern Land China 7% 30/12/2023	-	0,00
				USD 4	Modern Land China 8% 30/12/2024	-	0,00
				USD 3	Modern Land China 9% 30/12/2025	-	0,00
						-	0,00
				Total des obligations		-	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
CERTIFICATS DE DÉPÔT			
Chine			
CNY 30.000.000	Agricultural Bank of China 0% 3/11/2023**	4.094.752	0,27
Total des certificats de dépôt		4.094.752	0,27
Total des autres valeurs mobilières		4.094.752	0,27
Total du portefeuille		1.463.537.851	96,61
Autres éléments de l'actif net		51.369.736	3,39
Total de l'actif net (USD)		1.514.907.587	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	2.000.000	USD	2.185.968	HSBC Bank	20/9/2023	(14.396)
HKD	12.000.000	USD	1.536.152	HSBC Bank	20/9/2023	(4.926)
HKD	15.600.000	USD	1.996.905	Goldman Sachs	20/9/2023	(6.311)
SGD	2.000.000	USD	1.478.929	Goldman Sachs	20/9/2023	1.749
USD	118.694.609	CNY	852.103.000	BNY Mellon	20/9/2023	1.113.689
USD	4.265.534	JPY	603.000.000	Morgan Stanley	20/9/2023	129.195
USD	22.509.667	EUR	20.472.565	Goldman Sachs	20/9/2023	280.844
USD	10.123.200	HKD	78.978.272	Goldman Sachs	20/9/2023	45.402
USD	86.752.273	SGD	116.067.254	Goldman Sachs	20/9/2023	823.155
USD	10.625.974	CNH	76.770.000	JP Morgan	20/9/2023	65.171
USD	3.812.921	EUR	3.500.000	Barclays	20/9/2023	12.670
USD	1.660.315	HKD	13.000.000	UBS	20/9/2023	1.487
USD	1.956.781	EUR	1.800.000	Citigroup	20/9/2023	2.366
USD	652.541	EUR	600.000	RBS	20/9/2023	1.069
Plus-value nette non réalisée						2.451.164
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	19.819.039	USD	12.906.325	BNY Mellon	15/9/2023	(63.287)
USD	968.330	AUD	1.501.953	BNY Mellon	15/9/2023	(4.954)
Moins-value nette non réalisée						(68.241)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	85.805.271	USD	11.891.386	BNY Mellon	15/9/2023	(90.654)
USD	518.349	CNY	3.769.985	BNY Mellon	15/9/2023	(130)
Moins-value nette non réalisée						(90.784)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	164.930.234	USD	180.969.366	BNY Mellon	15/9/2023	(1.932.742)
USD	24.394.786	EUR	22.383.568	BNY Mellon	15/9/2023	96.852
Moins-value nette non réalisée						(1.835.890)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	18.288.593	USD	23.269.861	BNY Mellon	15/9/2023	(85.161)
USD	1.295.803	GBP	1.019.345	BNY Mellon	15/9/2023	3.564
Moins-value nette non réalisée						(81.597)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	165.736.163	USD	21.235.402	BNY Mellon	15/9/2023	(92.217)
USD	1.605.457	HKD	12.556.201	BNY Mellon	15/9/2023	3.648
Moins-value nette non réalisée						(88.569)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian High Yield Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	7.884	SGD	10.674	BNY Mellon	5/9/2023	(12)
SGD	133.124.684	USD	98.899.490	BNY Mellon	15/9/2023	(364.269)
USD	4.586.031	SGD	6.210.309	BNY Mellon	15/9/2023	(10.655)
Moins-value nette non réalisée						(374.936)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 644.558.306)						(88.853)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(169)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	18.740.516	(150.516)
(78)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	10.098.562	(158.438)
781	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	159.067.733	414.905
614	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	65.578.078	388.547
Total				253.484.889	494.498

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
311	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.700	15/9/2023	(325.978)	55.515
399	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.800	15/9/2023	(357.942)	45.786
68	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.300	20/10/2023	(505.366)	150.620
201	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.800	17/11/2023	15.822	190.929
283	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.300	15/12/2023	(303.898)	146.137
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 13.409.576)						(1.477.362)	588.987

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(710)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.500	15/9/2023	148.483	(4.526)
(68)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.000	20/10/2023	273.618	(45.560)
(201)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.600	17/11/2023	3.511	(37.161)
(283)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 8.300	15/12/2023	85.585	(19.846)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.773.126)						511.197	(107.093)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian High Yield Bond Fund suite

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
EUR 44.000.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.XO.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	(320.954)	30.228
USD 65.500.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(994.974)	13.726
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 16.801.541)				(1.315.928)	43.954

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
EUR (44.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.XO.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	166.822	(14.294)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 8.764.737)				166.822	(14.294)

Asian Multi-Asset Income Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				291	Himax Technologies	1.797	0,00
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES				23.500	HKBN	11.326	0,02
Australie				20.000	HKT Trust & HKT	21.318	0,03
66.521	APA	387.371	0,56	1.000	Innovent Biologics	4.475	0,01
97.542	Centuria Office REIT	81.190	0,12	843	iQIYI	4.228	0,01
41.070	Dexus	206.174	0,30	59.500	JD Health International	320.905	0,46
371.590	GDI Property Partnership	154.047	0,22	25.795	JD.com	423.614	0,61
17.279	Goodman	261.457	0,37	206	JOYY	7.233	0,01
76.317	GPT	207.625	0,30	483	Kanzhun	7.322	0,01
227.886	National Storage REIT*	342.463	0,49	1.888	KE	32.474	0,05
28.647	NEXTDC*	251.250	0,36	3.800	Kingsoft	15.165	0,02
83.522	Transurban	717.386	1,03	5.800	Kuaishou Technology	47.477	0,07
		2.608.963	3,75	107	Legend Biotech	7.463	0,01
Bermudes				2.300	Li Auto	47.390	0,07
12.600	China Gas	12.852	0,02	1.000	Li Ning	4.724	0,01
4.700	China Resources Gas	13.214	0,02	3.500	Longfor	7.372	0,01
40.500	CK Infrastructure	205.005	0,30	3.989	Lufax	4.926	0,01
337	Genpact	12.762	0,02	43.480	Meituan	712.380	1,02
1.500	Kerry Properties	2.773	0,00	169	Melco Resorts & Entertainment	1.862	0,00
16.000	Kunlun Energy	11.710	0,02	251	MINISO	6.536	0,01
		258.316	0,38	36.678	NagaCorp	18.706	0,03
Îles Vierges britanniques				5.955	NetEase	124.370	0,18
1.600	AsialInfo Technologies	1.952	0,00	2.876	New Oriental Education & Technology	15.530	0,02
Îles Caïmans				3.164	NIO*	33.618	0,05
462	Agora	1.333	0,00	1.288	PDD	128.117	0,18
121.256	Alibaba	1.394.533	2,00	402	Qifu Technology	6.842	0,01
6.000	ANTA Sports Products	67.589	0,10	4.000	Sands China	13.541	0,02
54	Atour Lifestyle	1.036	0,00	1.497	Sea	57.141	0,08
147	Autohome	4.253	0,01	100	Shenzhen International	1.026	0,00
7.578	Baidu	134.690	0,19	190	Silicon Motion Technology	10.325	0,01
252	Baozun	1.006	0,00	61.000	Sino Biopharmaceutical	23.177	0,03
100	BeiGene	1.622	0,00	7.000	Sunac Services	2.187	0,00
560	Bilibili	8.375	0,01	576.000	SUNeVision	275.406	0,39
84.000	Bosideng International	32.987	0,05	1.900	Sunny Optical Technology	15.529	0,02
26.800	Budweiser Brewing APAC	58.090	0,08	903	TAL Education	6.321	0,01
377	Chailease	2.101	0,00	40.000	Tencent	1.657.534	2,38
9.000	China Conch Venture	8.847	0,01	1.431	Tencent Music Entertainment	9.824	0,02
500	China East Education	215	0,00	2.000	Tingyi Cayman Islands	2.938	0,00
100.000	China Lesso	55.081	0,08	10.428	Trip.com	412.532	0,59
5.000	China Medical System	7.217	0,01	806	Trip.com	31.796	0,05
10.000	China Overseas Property	11.947	0,02	3.000	Uni-President China	2.219	0,00
16.000	China Resources Cement	5.304	0,01	510	Vipshop	8.089	0,01
2.000	China Resources Land	8.453	0,01	207	Vnet	784	0,00
3.000	China Resources Mixc Lifestyle Services	12.948	0,02	283	Weibo	3.721	0,01
31.000	China Yongda Automobiles Services	13.755	0,02	11.000	Wharf Real Estate Investment	45.863	0,07
200	Chow Tai Fook Jewellery	303	0,00	1.500	Wuxi Biologics Cayman	8.444	0,01
4.000	CIMC Enric	3.805	0,00	10.000	Xiabuxiabu Catering Management China	4.832	0,01
64.000	CK Asset	353.335	0,51	9.800	Xiaomi	15.444	0,02
6.000	Country Garden Services	6.900	0,01	700	XPeng*	6.564	0,01
11.500	CStone Pharmaceuticals	3.270	0,00	2.000	Yihai International	3.749	0,01
278	Dada Nexus	1.519	0,00	4.600	Zai Lab*	12.287	0,02
1.800	ENN Energy	14.114	0,02	12.000	Zhongsheng	36.568	0,05
130	Futu	7.834	0,01	907	ZTO Express Cayman	22.675	0,03
1.600	GDS	2.309	0,00			7.016.424	10,05
12.000	Geely Automobile	14.903	0,02	Chine			
3.000	Gourmet Master	10.645	0,02	800	360 Security Technology	1.229	0,00
5.220	Grab	19.131	0,03	41.000	Agricultural Bank of China	14.062	0,02
6.000	Greentown China	7.130	0,01	3.100	Aier Eye Hospital	7.678	0,01
12.000	Greentown Management	9.349	0,01	8.000	Aluminum of China	3.866	0,00
4.000	Greentown Service	1.867	0,00	120.000	Angang Steel	30.754	0,05
479	H World	19.361	0,03	2.400	Avary Shenzhen	7.056	0,01
178	Hello	1.581	0,00	6.000	AviChina Industry & Technology	2.693	0,00
				64.500	BAIC Motor	17.846	0,03
				137.000	Bank of China	46.465	0,07
				17.000	Bank of Communications	9.732	0,01
				2.000	Beijing Jingneng Clean Energy	426	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
18.000	Beijing Yanjing Brewery	25.681	0,04	16.100	Lens Technology	27.219	0,04
229.600	BOE Technology	126.550	0,18	400	Lepu Medical Technology	890	0,00
2.500	BYD	78.350	0,11	1.300	Lingyi iTech Guangdong	1.076	0,00
2.900	BYD	99.412	0,14	4.500	Livzon Pharmaceutical*	14.258	0,02
20.000	CGN Power	4.998	0,01	2.800	Livzon Pharmaceutical	13.239	0,02
6.000	China Communications Services	2.701	0,00	1.144	LONGi Green Energy Technology	4.175	0,01
574.000	China Construction Bank	307.383	0,44	56.000	Maanshan Iron & Steel	9.568	0,01
312.000	China Life Insurance	473.392	0,68	121.000	Metallurgical of China	26.382	0,04
30.000	China Longyuan Power	23.754	0,04	100	NAURA Technology	3.729	0,01
4.000	China Merchants	7.813	0,01	2.000	New China Life Insurance	5.008	0,01
21.000	China Merchants Bank	83.004	0,12	800	Nongfu Spring	4.493	0,01
3.000	China Merchants Bank	13.010	0,02	2.100	Onewo	7.444	0,01
2.000	China Oilfield Services	2.267	0,00	46.400	Orient	25.794	0,04
6.600	China Pacific Insurance	15.114	0,02	133.000	People's Insurance of China	45.277	0,06
92.000	China Petroleum & Chemical	53.842	0,08	3.700	Perfect World	7.033	0,01
38.000	China Railway	20.107	0,03	113.500	PetroChina	81.909	0,12
6.300	China State Construction Engineering	4.875	0,01	3.300	PetroChina	3.515	0,01
46.000	China Suntien Green Energy	16.188	0,02	16.000	PICC Property & Casualty	18.401	0,03
2.556.000	China Tower	247.681	0,36	22.500	Ping An Insurance of China	134.691	0,19
4.800	China United Network Communications	3.437	0,01	2.600	Ping An Insurance of China	17.436	0,02
5.500	China Vanke	6.417	0,01	70.000	Postal Savings Bank of China*	34.540	0,05
3.500	CITIC	6.837	0,01	6.600	SAIC Motor	13.027	0,02
1.500	CITIC	4.577	0,01	3.668	SDIC Capital	3.696	0,01
33.000	CMOC	19.733	0,03	9.800	SF	58.568	0,09
1.400	CMOC	1.103	0,00	4.000	Shanghai Electric	898	0,00
908	Contemporary Amperex Technology	29.523	0,04	300	Shanghai Pharmaceuticals	493	0,00
3.000	COSCO SHIPPING	3.079	0,01	9.600	Shanghai Pharmaceuticals	23.593	0,03
11.000	CRRC	5.414	0,01	480	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory	15.970	0,02
3.600	CRRC	2.939	0,01	200	Shenzhen Inovance Technology	1.877	0,00
6.000	Datang International Power Generation	949	0,00	1.322	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	49.062	0,07
1.500	DHC Software	1.386	0,00	196	Shenzhen New Energy Technology	2.386	0,00
3.520	Dong-E-E-Jiao	25.077	0,04	6.660	Sichuan Kelun Pharmaceutical	24.808	0,04
4.700	FAW Jiefang	5.543	0,01	3.200	Sinopharm	9.282	0,01
5.500	Focus Media Information Technology	5.821	0,01	200	Sungrow Power Supply	2.742	0,00
1.200	Fuyao Glass Industry	5.432	0,01	300	Sunwoda Electronic	653	0,00
24.000	Goldwind Science & Technology	12.607	0,02	800	Tianqi Lithium	4.386	0,01
1.300	Goldwind Science & Technology	1.698	0,00	493	Tongwei	2.174	0,00
4.000	Great Wall Motor	4.743	0,01	100	Tsingtao Brewery	1.252	0,00
9.962	Gree Electric Appliances of Zhuhai	49.007	0,07	4.000	Weichai Power	5.192	0,01
22.000	Guangzhou Automobile	11.585	0,02	1.000	Weichai Power	1.622	0,00
3.800	Haier Smart Home	11.749	0,02	500	Wuliangye Yibin	10.715	0,02
1.000	Hainan Meilan International Airport	960	0,00	300	WuXi AppTec	3.361	0,01
600	Hangzhou Tigermed Consulting	3.270	0,00	26.400	Zhengzhou Coal Mining Machinery	24.236	0,03
6.000	Hisense Home Appliances	15.836	0,02	200	Zhongji Innolight	3.151	0,00
16.000	Huaneng Power International	7.997	0,01	5.700	Zhongjin Gold	8.712	0,01
4.500	Huayu Automotive Systems	11.622	0,02	1.300	Zhuzhou CRRC Times Electric	4.533	0,01
1.300	Hubei Jumpcan Pharmaceutical	4.678	0,01	14.000	Zijin Mining	22.027	0,03
300	Hundsun Technologies	1.484	0,00	3.000	Zijin Mining	5.097	0,01
143.000	Industrial & Commercial Bank of China	65.638	0,09	49.600	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology	23.716	0,03
7.900	Inner Mongolia Yili Industrial	28.232	0,04	1.100	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology	977	0,00
14.000	Jiangsu Expressway	12.638	0,02	1.800	ZTE	5.795	0,01
102	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock	1.881	0,00	566	ZTE	2.758	0,00
10.000	Jiangxi Copper	15.606	0,02			3.010.847	4,34
281	Jiangxi Copper	730	0,00	Hong Kong			
40	Joinn Laboratories China	80	0,00	39.800	AIA	361.312	0,52
200	Kweichow Moutai	50.774	0,07	127.000	BOC Hong Kong	353.004	0,51
				3.000	BYD Electronic International	13.904	0,02
				6.000	Cathay Pacific Airways	6.396	0,01
				5.000	China Overseas Land & Investment	10.544	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Asian Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Italie				26.800	Keppel Infrastructure Trust	9.814	0,01
1.900	PRADA	12.416	0,02	16.000	Keppel REIT*	10.239	0,01
Japon				1.500	Mapletree Industrial Trust	2.552	0,00
333	Canadian Solar Infrastructure Fund	270.446	0,39	197.800	Mapletree Pan Asia Commercial Trust	222.426	0,32
29.200	Hulic	261.323	0,37	652.400	NETLINK NBN TRUST	417.489	0,60
271	Ichigo Office REIT Investment	165.951	0,24	8.500	Oversea-Chinese Banking	78.918	0,11
17.200	Keihanshin Building	150.164	0,22	1.000	Sembcorp Industries	3.958	0,01
128	Kenedix Office Investment	301.269	0,43	9.000	Singapore Airlines	45.742	0,07
85	Mitsui Fudosan Logistics Park	288.170	0,41	30.200	Singapore Telecommunications	53.174	0,07
2.400	West Japan Railway*	103.517	0,15	3.100	United Overseas Bank	65.224	0,09
		1.540.840	2,21			3.168.824	4,55
Jersey				Corée du Sud			
319	WNS	21.083	0,03	145	AfreecaTV	8.963	0,01
Malaisie				49	AMOREPACIFIC	1.247	0,00
8.300	Axiata	4.222	0,01	119	Celltrion	12.956	0,02
12.400	CIMB	15.046	0,02	1.004	Cheil Worldwide	14.318	0,02
5.400	IHH Healthcare	6.925	0,01	43	Chunbo	4.899	0,01
14.900	Malayan Banking	29.254	0,04	187	CJ Logistics	11.163	0,02
10.700	Malaysia Airports	16.995	0,02	236	CLIO Cosmetics	3.866	0,00
24.700	MISC	38.328	0,06	110	Com2uSCorp	3.945	0,00
4.300	Petronas Dagangan	20.573	0,03	464	Coway	15.165	0,02
28.700	Public Bank	26.164	0,04	356	DB Insurance	22.005	0,03
8.200	QL Resources	9.543	0,01	45	DIO	1.009	0,00
7.800	Sime Darby	3.866	0,01	62	Doosan Bobcat	2.524	0,01
27.200	Tenaga Nasional	57.683	0,08	299	Doosan Enerbility	4.122	0,01
800	TIME dotCom	948	0,00	59.419	ESR Kendall Square REIT	176.447	0,25
54.000	YTL	18.271	0,03	1.149	GS Engineering & Construction	12.631	0,02
		247.818	0,36	972	Hana Financial	29.085	0,04
Maurice				370	Hankook Tire & Technology	10.847	0,02
368	MakeMyTrip	14.164	0,02	4.122	Hanon Systems	28.410	0,04
Philippines				74	Hansol Chemical	9.042	0,01
94.000	AREIT	55.201	0,08	182	Hanwha Systems	1.849	0,00
308	Bank of the Philippine Islands	599	0,00	188	HD Hyundai	8.406	0,01
390	GT Capital	3.944	0,01	166	HD Hyundai Infracore	1.322	0,00
1.780	International Container Terminal Services	6.514	0,01	115	HL Mando	3.646	0,00
830	Jollibee Foods	3.474	0,00	15	Hugel	1.276	0,00
4.740	Manila Electric	28.765	0,04	548	Hyundai Engineering & Construction	14.718	0,02
878.800	MREIT	209.844	0,30	119	Hyundai Glovis	15.531	0,02
4.410	SM Investments	64.880	0,10	116	Hyundai Mobis	20.273	0,03
		373.221	0,54	482	Hyundai Motor	68.959	0,10
Fédération de Russie				1.113	Hyundai Steel	30.483	0,04
4.000	United RUSAL International	1.306	0,00	648	K Car	5.913	0,01
Singapour				255	KakaoBank	5.084	0,01
322.100	AIMS APAC REIT	300.246	0,43	238	Kangwon Land	2.793	0,00
3.100	CapitaLand Ascendas REIT	6.353	0,01	1.193	KB Financial	48.830	0,07
203.100	CapitaLand Ascott Trust	145.746	0,21	167	KCC	27.607	0,04
309.003	CapitaLand China Trust	206.884	0,30	2.031	Kia	123.235	0,18
1.119	Capitaland India Trust	960	0,00	61	Korea Investment	2.400	0,00
125.704	CapitaLand Integrated Commercial Trust	177.622	0,26	261	Korean Air Lines	4.502	0,01
109.500	CapitaLand Investment	262.467	0,38	62	Krafton	7.271	0,01
2.000	CDL Hospitality Trusts	1.524	0,00	552	KT	13.782	0,02
1.400	ComfortDelGro	1.315	0,00	111	LG Chem	48.960	0,07
160.620	Cromwell European Real Estate Investment Trust	247.455	0,36	213	LG Display	2.159	0,00
5.000	DBS	123.177	0,18	80	LG H&H	28.114	0,04
443.869	ESR-LOGOS REIT	101.796	0,15	4.471	LG Uplus	35.348	0,05
187.154	Frasers Centrepoint Trust	310.143	0,45	10	LOTTE Fine Chemical	457	0,00
229.500	Frasers Logistics & Commercial Trust	203.741	0,29	29	Lotte Shopping	1.558	0,00
24.800	Genting Singapore	16.054	0,02	28	LS Electric	2.114	0,00
94.500	Keppel DC REIT	153.805	0,22	410	LX Hausys	15.882	0,02
				288	LX International	6.613	0,01
				171	Meritz Financial	7.077	0,01
				302	NAVER	49.010	0,07
				177	NCSOFT	33.679	0,05
				153	Netmarble	4.960	0,01
				4.702	NH Investment & NHH	36.641	0,05
				724	NHN	14.242	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Asian Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Indonésie				MYR 590.000	Malaysia Government Bond 2,632% 15/4/2031	117.252	0,17
USD 200.000	Bank Mandiri Persero 5,5% 4/4/2026	199.638	0,29	MYR 700.000	Malaysia Government Bond 3,733% 15/6/2028	151.449	0,22
USD 200.000	Bank Negara Indonesia Persero 3,75% 30/3/2026	186.265	0,27	MYR 420.000	Malaysia Government Bond 3,757% 22/5/2040	86.518	0,12
USD 200.000	Bank Tabungan Negara Persero 4,2% 23/1/2025	190.040	0,27	MYR 708.000	Malaysia Government Bond 4,254% 31/5/2035	156.152	0,22
USD 200.000	Freeport Indonesia 5,315% 14/4/2032*	186.234	0,27	MYR 200.000	Malaysia Government Investment Issue 3,599% 31/7/2028	43.034	0,06
USD 200.000	Hyundai Motor Manufacturing Indonesia 1,75% 6/5/2026	179.337	0,26	MYR 400.000	Malaysia Government Investment Issue 4,128% 15/8/2025	87.478	0,13
USD 200.000	Indonesia Government International Bond 3,85% 18/7/2027	191.617	0,27	MYR 100.000	Malaysia Government Investment Issue 4,291% 14/8/2043	21.735	0,03
USD 200.000	Indonesia Government International Bond 4,35% 11/1/2048	171.562	0,25	MYR 310.000	Malaysia Government Investment Issue 4,638% 15/11/2049	69.884	0,10
IDR 7.400.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/9/2030	503.132	0,72			902.504	1,29
IDR 7.363.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/2/2033	504.967	0,73	Maurice			
IDR 1.060.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2038	73.880	0,11	USD 200.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	179.648	0,26
IDR 1.140.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2042	78.408	0,11	USD 186.000	Clean Renewable Power Mauritius 4,25% 25/3/2027	162.341	0,23
USD 200.000	Pakuwon Jati 4,875% 29/4/2028	180.851	0,26	USD 200.000	Greenko Solar Mauritius 5,55% 29/1/2025*	193.967	0,28
USD 200.000	Pertamina Persero 6,45% 30/5/2044	201.996	0,29	USD 200.000	Greenko Wind Projects Mauritius 5,5% 6/4/2025	192.848	0,28
USD 200.000	Sarana Multi Infrastruktur Perusahaan Perseroan Persero 2,05% 11/5/2026	176.000	0,25	USD 250.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024	246.250	0,35
		3.023.927	4,35	USD 250.000	India Green Power 4% 22/2/2027	221.460	0,32
International				USD 200.000	Network i2i 5,65% 15/1/2025	194.683	0,28
INR 14.000.000	Asian Development Bank 6,15% 25/2/2030	162.591	0,24			1.391.197	2,00
INR 12.000.000	Asian Infrastructure Investment Bank/The 5,75% 25/1/2027	138.477	0,20	Mongolie			
INR 12.000.000	International Bank for Reconstruction & Development 5,5% 21/1/2027	138.190	0,20	USD 200.000	Mongolia Government International Bond 3,5% 7/7/2027	168.032	0,24
		439.258	0,64	Pays-Bas			
Japon				USD 188.000	Greenko Dutch 3,85% 29/3/2026*	170.182	0,25
USD 200.000	Asahi Mutual Life Insurance 6,5% 5/9/2023	200.000	0,29	USD 200.000	Minejesa Capital 4,625% 10/8/2030	181.321	0,26
USD 200.000	Mizuho Financial 2,564% 13/9/2031	155.753	0,22	USD 250.000	Mong Duong Finance 5,125% 7/5/2029	226.700	0,33
USD 200.000	Nissan Motor 4,81% 17/9/2030*	176.572	0,25	EUR 200.000	Syngenta Finance 3,375% 16/4/2026	210.602	0,30
EUR 100.000	SoftBank 3,125% 19/9/2025	103.137	0,15			788.805	1,14
		635.462	0,91	Pakistan			
Jersey				USD 200.000	Pakistan Government International Bond 6% 8/4/2026*	104.540	0,15
USD 177.420	Galaxy Pipeline Assets Bidco 2,16% 31/3/2034	149.251	0,21	USD 200.000	Pakistan Government International Bond 6,875% 5/12/2027*	102.660	0,15
Koweït						207.200	0,30
USD 200.000	Burgan Bank SAK 5,749% 9/7/2024	180.525	0,26	Philippines			
Luxembourg				USD 200.000	Globe Telecom 4,2% 2/8/2026	186.789	0,27
USD 200.000	EIG Pearl 3,545% 31/8/2036	166.540	0,24	PHP 4.400.000	Philippine Government Bond 2,625% 12/8/2025	72.720	0,10
USD 200.000	Greensaf Pipelines Bidco 6,129% 23/2/2038*	201.020	0,29	PHP 2.100.000	Philippine Government Bond 4,625% 9/9/2040	29.857	0,04
		367.560	0,53	PHP 9.000.000	Philippine Government Bond 4,875% 20/1/2032	144.551	0,21
Malaisie							
USD 200.000	Dua Capital 2,78% 11/5/2031	169.002	0,24				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
PHP 1.600.000	Philippine Government Bond 5,25% 18/5/2037	25.117	0,04	KRW 13.400.000	Korea Treasury Bond 2% 10/6/2031	8.945	0,01
PHP 4.900.000	Philippine Government Bond 6,25% 22/3/2028	86.838	0,13	KRW 55.000.000	Korea Treasury Bond 2,375% 10/12/2031	37.569	0,05
PHP 3.500.000	Philippine Government Bond 6,75% 15/9/2032	63.708	0,09	KRW 206.380.000	Korea Treasury Bond 2,625% 10/6/2028	149.126	0,22
PHP 4.200.000	Philippine Government Bond 7% 13/7/2038	77.673	0,11	KRW 80.000.000	Korea Treasury Bond 3% 10/12/2042	54.074	0,08
USD 200.000	Rizal Commercial Banking 6,5% 27/8/2025	183.208	0,26	KRW 35.000.000	Korea Treasury Bond 3,25% 10/9/2042	24.571	0,04
USD 200.000	SMC Global Power 7% 21/10/2025	162.088	0,23	USD 200.000	Mirae Asset 6,875% 26/7/2026	201.351	0,29
		1.032.549	1,48	USD 200.000	POSCO 5,75% 17/1/2028	201.462	0,29
				USD 200.000	Shinhan Bank 4% 23/4/2029	182.176	0,26
				USD 200.000	SK Hynix 2,375% 19/1/2031	155.077	0,22
				USD 200.000	SK Hynix 6,25% 17/1/2026	200.826	0,29
				USD 200.000	SK On 5,375% 11/5/2026*	199.239	0,29
				USD 200.000	Tongyang Life Insurance 5,25% 22/9/2025	178.145	0,25
						3.302.119	4,75
	Arabie Saoudite				Sri Lanka		
USD 200.000	Saudi Government International Bond 4,5% 26/10/2046	169.395	0,24	USD 250.000	Sri Lanka Government International Bond 6,825% 18/7/2026	118.221	0,17
				USD 300.000	Sri Lanka Government International Bond 6,85% 3/11/2025	141.848	0,20
						260.069	0,37
	Singapour				Thaïlande		
USD 200.000	ABJA Investment 5,95% 31/7/2024	199.487	0,29	USD 200.000	Bangkok Bank 3,466% 23/9/2036	160.852	0,23
USD 200.000	BOC Aviation 1,75% 21/1/2026	182.799	0,26	USD 200.000	Bangkok Bank 3,733% 25/9/2034	170.102	0,25
USD 200.000	BPRL International Singapore 4,375% 18/1/2027	191.081	0,28	USD 200.000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025	189.400	0,27
USD 178.250	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027	166.441	0,24	USD 200.000	GC Treasury Center 4,4% 30/3/2032	173.157	0,25
USD 160.920	LLPL Capital 6,875% 4/2/2039*	142.877	0,20	USD 400.000	Kasikornbank 3,343% 2/10/2031*	358.934	0,52
USD 200.000	Medco Laurel Tree 6,95% 12/11/2028	182.122	0,26	USD 200.000	Krung Thai Bank 4,4% 25/3/2026*	182.000	0,26
USD 200.000	Medco Oak Tree 7,375% 14/5/2026	196.540	0,28	USD 200.000	Muang Thai Life Assurance 3,552% 27/1/2037	177.720	0,25
USD 200.000	Oversea-Chinese Banking 1,832% 10/9/2030	183.909	0,27	THB 300.000	Thailand Government Bond 1,6% 17/6/2035	7.518	0,01
USD 200.000	Singapore Airlines 3% 20/7/2026	188.088	0,27	THB 3.300.000	Thailand Government Bond 2% 17/6/2042	79.501	0,12
SGD 60.000	Singapore Government Bond 1,25% 1/11/2026	41.635	0,06	THB 7.500.000	Thailand Government Bond 2,875% 17/12/2028	217.755	0,31
SGD 30.000	Singapore Government Bond 1,875% 1/10/2051	17.429	0,03	THB 3.197.000	Thailand Government Bond 3,35% 17/6/2033	95.795	0,14
SGD 300.000	Singapore Government Bond 2,375% 1/7/2039	201.427	0,29	THB 2.650.000	Thailand Government Bond 3,4% 17/6/2036	79.381	0,11
SGD 230.000	Singapore Government Bond 2,625% 1/5/2028	166.623	0,24	THB 1.657.000	Thailand Government Bond 3,6% 17/6/2067	47.843	0,07
SGD 50.000	Singapore Government Bond 2,625% 1/8/2032	35.519	0,05	THB 400.000	Thailand Government Bond 3,775% 25/6/2032	12.323	0,02
SGD 150.000	Singapore Government Bond 2,75% 1/3/2046	105.636	0,15	THB 569.000	Thailand Government Bond 4,85% 17/6/2061	20.130	0,03
SGD 60.000	Singapore Government Bond 3,5% 1/3/2027	44.746	0,06	USD 200.000	TMBThanachart Bank 4,9% 2/12/2024	192.750	0,28
USD 200.000	TML 4,35% 9/6/2026	184.562	0,27			2.165.161	3,12
		2.430.921	3,50		Royaume-Uni		
	Corée du Sud			USD 200.000	HSBC 3,973% 22/5/2030	180.003	0,26
USD 200.000	Doosan Enerbility 5,5% 17/7/2026	200.348	0,29	USD 200.000	Standard Chartered 2,608% 12/1/2028	178.662	0,26
USD 200.000	GS Caltex 1,625% 27/7/2025	185.109	0,27	USD 200.000	Standard Chartered 4,866% 15/3/2033	182.005	0,26
USD 200.000	Hanwha Life Insurance 3,379% 4/2/2032	179.754	0,26				
USD 300.000	KB Capital 1,5% 28/10/2025*	270.843	0,39				
USD 200.000	Kookmin Bank 4,35% 2/7/2024	195.151	0,28				
USD 200.000	Korea Gas 2,25% 18/7/2026	183.718	0,26				
KRW 460.000.000	Korea Treasury Bond 1,5% 10/12/2030	299.152	0,43				
KRW 30.000.000	Korea Treasury Bond 1,625% 10/9/2070	12.236	0,02				
KRW 344.000.000	Korea Treasury Bond 1,875% 10/3/2051	183.247	0,26				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Asian Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 200.000	Standard Chartered 6,296% 6/7/2034	199.189	0,29	Autres titres négociables			
USD 300.000	Vedanta Resources Finance II 8,95% 11/3/2025	196.785	0,28	ACTIONS ORDINAIRES			
		936.644	1,35	Îles Caïmans			
				12.000	CIFI Ever Sunshine Services***	3.273	0,01
États-Unis						Total des actions ordinaires	3.273 0,01
USD 200.000	Hanwha Q Cells Americas 5% 27/7/2028	197.971	0,28	Total des autres valeurs mobilières			
USD 200.000	Hyundai Capital America 5,5% 30/3/2026	198.732	0,29	Total du portefeuille			
USD 200.000	Resorts World Las Vegas / RWLV Capital 4,625% 16/4/2029	163.860	0,23	Autres éléments de l'actif net			
		560.563	0,80	Total de l'actif net (USD)			
Total des obligations			31.883.353	45,81			
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			66.286.486	95,24			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
CNH	375.000	USD	52.691	JP Morgan	20/9/2023	(1.104)
HKD	2.509.002	USD	321.596	Goldman Sachs	20/9/2023	(1.442)
HKD	2.530.000	USD	322.821	Citigroup	20/9/2023	12
IDR	2.300.000.000	USD	150.052	Goldman Sachs	20/9/2023	934
INR	25.000.000	USD	301.462	Barclays	20/9/2023	509
KRW	193.330.000	USD	148.509	Bank of America	20/9/2023	(2.218)
MYR	233.000	USD	51.254	Goldman Sachs	20/9/2023	(981)
PHP	420.000	USD	7.642	Citigroup	20/9/2023	(227)
THB	11.692.705	USD	336.510	Bank of America	20/9/2023	(2.069)
USD	199.678	PHP	11.128.000	BNP Paribas	16/10/2023	3.341
USD	544.115	THB	18.680.000	Goldman Sachs	16/10/2023	8.434
USD	110.913	IDR	1.680.000.000	Citigroup	20/9/2023	627
USD	219.901	EUR	200.000	Goldman Sachs	20/9/2023	2.744
USD	35.001	INR	2.900.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(27)
USD	296.091	IDR	4.502.500.000	Bank of America	20/9/2023	519
USD	321.495	HKD	2.509.002	Barclays	20/9/2023	1.341
USD	108.710	EUR	100.000	Citigroup	20/9/2023	131
Plus-value nette non réalisée						10.524
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	7.732	USD	5.061	BNY Mellon	15/9/2023	(51)
USD	183	AUD	284	BNY Mellon	15/9/2023	(1)
Moins-value nette non réalisée						(52)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	6.803	USD	5.067	BNY Mellon	15/9/2023	(37)
USD	180	CAD	243	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(37)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	36.567	USD	5.075	BNY Mellon	15/9/2023	(47)
USD	192	CNY	1.394	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(47)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Multi-Asset Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	4.620	USD	5.079	BNY Mellon	15/9/2023	(65)
USD	185	EUR	171	BNY Mellon	15/9/2023	1
Moins-value nette non réalisée						(64)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	3.992	USD	5.086	BNY Mellon	15/9/2023	(25)
USD	179	GBP	141	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(25)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	291.948	USD	37.407	BNY Mellon	15/9/2023	(162)
USD	1.516	HKD	11.858	BNY Mellon	15/9/2023	3
Moins-value nette non réalisée						(159)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	722.229	USD	5.060	BNY Mellon	15/9/2023	(109)
USD	202	JPY	29.227	BNY Mellon	15/9/2023	1
Moins-value nette non réalisée						(108)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	61.121	USD	45.405	BNY Mellon	15/9/2023	(165)
USD	1.869	SGD	2.531	BNY Mellon	15/9/2023	(4)
Moins-value nette non réalisée						(169)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 3.618.197)						9.863

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
1	KRW	Korean 10 Year Bond	Septembre 2023	82.905	(469)
3	KRW	Korean 3 Year Bond	Septembre 2023	235.052	(908)
(11)	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	541.915	2.837
26	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	2.883.156	24.550
2	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	213.610	1.251
(2)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	213.609	(750)
Total				4.170.247	26.511

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
IRS	HKD 610.000	Fund receives Fixed 4,142%; and pays Floating HKD HIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2025	(504)	(504)
IRS	HKD 600.000	Fund receives Fixed 3,805%; and pays Floating HKD HIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2028	(1.007)	(1.007)
IRS	HKD 720.000	Fund receives Fixed 3,606%; and pays Floating HKD HIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	(3.093)	(3.093)
IRS	INR 12.700.000	Fund receives Fixed 6,1205%; and pays Floating INR MIBOR 1 Day	Goldman Sachs	20/9/2033	(6.205)	(6.205)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 241.518)					(10.809)	(10.809)

IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Asian Multi-Asset Income Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
678	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.425	20/10/2023	(10.557)	25.546
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 907.602)						(10.557)	25.546

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ moins-values non réalisées USD	Valeur de marché USD
(62.100)	Call	Alibaba	Bank of America	HKD 93,96	7/9/2023	30.363	(4.156)
(61.500)	Call	BOC Hong Kong	Bank of America	HKD 23,23	7/9/2023	3.583	(59)
(294.000)	Call	Cheng Lie Navigation	Bank of America	HKD 11,953	7/9/2023	6.874	(7.397)
(167.000)	Call	China Construction Bank	Bank of America	HKD 4,39	7/9/2023	1.706	(70)
(14.600)	Call	JD.com	Bank of America	HKD 148,51	7/9/2023	14.920	(40)
(26.700)	Call	Meituan	Bank of America	HKD 131,14	7/9/2023	17.473	(6.021)
(59.500)	Call	UHT Unitech	Bank of America	HKD 53,92	7/9/2023	26.070	(9)
(15.300)	Call	Alibaba	Bank of America	HKD 102,76	13/9/2023	5.613	(212)
(50.500)	Call	BOC Hong Kong	Bank of America	HKD 23,381	13/9/2023	3.433	(119)
(147.000)	Call	China Construction Bank	Bank of America	HKD 4,522	13/9/2023	1.346	(52)
(8.700)	Call	ICICI Bank	Bank of America	USD 24,26	13/9/2023	3.116	(269)
(3.500)	Call	JD.com	Bank of America	HKD 167,97	13/9/2023	2.155	(3)
(5.000)	Call	MediaTek	Bank of America	USD 741,3	13/9/2023	2.337	(567)
(4.800)	Call	Meituan	Bank of America	HKD 154,77	13/9/2023	2.656	(39)
(41.000)	Call	Taiwan Semiconductor Manufacturing	Bank of America	USD 571,2	13/9/2023	16.931	(2.251)
(10.500)	Call	Tencent	Bank of America	HKD 356,78	13/9/2023	12.793	(736)
(5.900)	Call	MediaTek	BNP Paribas	USD 723,84	7/9/2023	3.215	(770)
(96.000)	Call	Taiwan Semiconductor Manufacturing	BNP Paribas	USD 598,43	7/9/2023	40.810	(35)
(13.000)	Call	Tencent	BNP Paribas	HKD 342,99	7/9/2023	20.568	(1.056)
(678)	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.125	20/10/2023	6.587	(7.980)
(19.600)	Call	Samsung Electronics	Goldman Sachs	USD 73.851	7/9/2023	21.097	(12)
(3.850)	Call	SK Hynix	Goldman Sachs	USD 121.025	7/9/2023	5.857	(8.267)
(5.200)	Call	Trip.com	Goldman Sachs	USD 38,22	7/9/2023	(2.186)	(10.292)
(8.500)	Call	Infosys	Goldman Sachs	USD 16,933	13/9/2023	(2.787)	(5.315)
(28.000)	Call	Hon Hai Precision Industry	JP Morgan	USD 110,16	13/9/2023	1.917	(339)
(3.200)	Call	SK Hynix	JP Morgan	USD 125.475	13/9/2023	4.423	(4.328)
(33.000)	Call	Hon Hai Precision Industry	Morgan Stanley	USD 111,755	7/9/2023	1.799	(42)
(15.700)	Call	Samsung Electronics	Morgan Stanley	USD 71.483,806	13/9/2023	19.634	(936)
(5.200)	Call	Trip.com	Morgan Stanley	USD 41,002	13/9/2023	685	(5.163)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 1.791.145)						272.988	(66.535)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Sustainable Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Bermudes							
144.000	China Water Affairs	110.529	1,32				
Îles Caïmans							
4.670	Alibaba	433.189	5,16				
776	Baidu	110.766	1,32				
42.000	China Mengniu Dairy	141.375	1,68				
12.270	Meituan	201.033	2,39				
7.700	NetEase	160.814	1,91				
4.800	Tencent	198.904	2,37				
3.476	Tencent*	144.880	1,73				
28.000	Wuxi Biologics Cayman	157.619	1,88				
100.000	Xinyi Solar	83.514	1,00				
		1.632.094	19,44				
Chine							
25.500	China Merchants Bank	100.791	1,20				
4.660	Contemporary Amperex Technology	151.515	1,81				
6.983	Ganfeng Lithium	45.505	0,54				
9.400	Ganfeng Lithium	44.944	0,54				
37.200	Haier Smart Home	120.210	1,43				
22.960	LONGi Green Energy Technology	83.788	1,00				
32.900	Ming Yang Smart Energy	67.515	0,80				
14.700	Shenzhen Inovance Technology	137.961	1,64				
7.300	Sungrow Power Supply	100.088	1,19				
		852.317	10,15				
Hong Kong							
22.800	AIA	206.983	2,46				
35.000	BOC Hong Kong	97.285	1,16				
50.000	Hang Lung Properties	66.811	0,80				
		371.079	4,42				
Inde							
47.683	Aditya Birla Capital	104.338	1,24				
477	Axis Bank	5.609	0,07				
2.570	Axis Bank	151.116	1,80				
23.732	Crompton Greaves Consumer Electricals	86.014	1,02				
490	HDFC Bank	9.301	0,11				
1.539	HDFC Bank	96.280	1,15				
10.211	ICICI Bank	237.814	2,83				
1.318	ICICI Bank	15.264	0,18				
9.337	Infosys	162.931	1,94				
3.313	Infosys	57.445	0,68				
909	Mahindra & Mahindra	17.298	0,21				
10.156	Mahindra & Mahindra	194.488	2,32				
16.181	Marico	111.419	1,33				
		1.249.317	14,88				
				Indonésie			
		231.400		231.400	Bank Central Asia	139.402	1,66
		435.000		435.000	Bank Rakyat Indonesia Persero	158.520	1,89
						297.922	3,55
				Singapour			
		116.100		116.100	ComfortDelGro	109.081	1,30
		14.100		14.100	Oversea-Chinese Banking	130.912	1,56
		69.500		69.500	Singapore Telecommunications	122.371	1,46
						362.364	4,32
				Corée du Sud			
		2.067		2.067	Hanwha Solutions	57.002	0,68
		225		225	Korea Zinc	89.710	1,07
		215		215	Samsung Electronics	271.975	3,24
		8.111		8.111	Samsung Electronics	331.374	3,95
		276		276	Samsung SDI	128.212	1,53
		1.425		1.425	SK Hynix	131.315	1,56
		851		851	SK Innovation	114.282	1,36
						1.123.870	13,39
				Taïwan			
		11.000		11.000	Accton Technology	165.104	1,97
		32.000		32.000	Chunghwa Telecom	116.559	1,39
		14.000		14.000	Delta Electronics	152.104	1,81
		5.000		5.000	Lotes	135.808	1,62
		22.000		22.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	379.257	4,52
		3.789		3.789	Taiwan Semiconductor Manufacturing	355.673	4,23
						1.304.505	15,54
				Thaïlande			
		25.600		25.600	Advanced Info Service	157.909	1,88
		201.000		201.000	Bangkok Dusit Medical Services	160.720	1,91
						318.629	3,79
				Royaume-Uni			
		8.304		8.304	Prudential	103.589	1,23
				États-Unis			
		387		387	Albemarle	76.955	0,92
		2.287		2.287	Cognizant Technology Solutions	163.955	1,95
						240.910	2,87
						7.967.125	94,90
						7.967.125	94,90
						428.115	5,10
						8.395.240	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Asian Sustainable Equity Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Technologie	23,98
Communications	21,20
Finance	19,34
Valeurs industrielles	7,69
Biens de consommation non cyclique	6,80
Biens de consommation cyclique	6,79
Énergie	5,35
Matériaux de base	3,75
Autres éléments de l'actif net	5,10
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Tiger Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 975.000	China Great Wall International IV 3,125% 31/7/2024*	921.375	0,03
				USD 3.591.000	China Great Wall International V 2,375% 18/8/2030	2.338.028	0,08
				USD 4.445.000	China Great Wall International VI 4,25% 28/4/2025	4.097.801	0,14
				USD 6.488.000	China Huaneng Hong Kong Treasury Management 3,08% 9/12/2025*	6.104.430	0,22
				USD 1.000.000	China Railway Xunjie 3,25% 28/7/2026	941.450	0,03
				USD 4.700.000	Chinalco Capital 2,125% 3/6/2026	4.286.612	0,15
				USD 8.000.000	Chinalco Capital 2,95% 24/2/2027	7.425.760	0,27
				USD 2.813.000	CLP Power HK Finance 3,55% 6/2/2025	2.695.712	0,10
				USD 5.949.000	CNOOC Finance 2003 5,5% 21/5/2033*	6.035.063	0,22
				USD 6.700.000	CNPC Global Capital 1,35% 23/6/2025	6.214.082	0,22
				USD 9.091.000	CNPC HK Overseas Capital 5,95% 28/4/2041*	9.666.279	0,35
				USD 4.250.000	Coastal Emerald 4,3% 1/8/2024*	4.145.599	0,15
				USD 3.532.000	Elect Global Investments 4,1% 3/6/2025	2.872.629	0,10
				USD 2.550.000	ENN Clean Energy International Investment 3,375% 12/5/2026*	2.343.603	0,08
				HKD 16.000.000	Farsail Goldman International 7% 24/11/2026	561.011	0,02
				USD 1.500.000	Fortune Star BVI 5,95% 19/10/2025	1.178.700	0,04
				USD 2.100.000	Fortune Star BVI 6,85% 2/7/2024*	1.917.562	0,07
				USD 1.329.000	Greenland Global Investment 6,75% 26/9/2025	139.545	0,01
				USD 2.000.000	Guojing Capital BVI 6,3% 2/12/2025*	2.018.651	0,07
				USD 1.600.000	HKT Capital No 2 3,625% 2/4/2025*	1.548.888	0,05
				USD 300.000	HKT Capital No 4 3% 14/7/2026	279.191	0,01
				USD 6.795.000	HKT Capital No 6 3% 18/1/2032*	5.632.749	0,20
				USD 900.000	Huafa 2019 I 4,25% 3/7/2024	877.361	0,03
				USD 1.250.000	Huafa 2020 I 2,8% 4/11/2025*	1.133.731	0,04
				USD 2.400.000	Huantaihu International Investment 7,3% 16/2/2026	2.388.000	0,09
				USD 2.301.000	Huarong Finance 2017 4,25% 7/11/2027	1.739.671	0,06
				USD 2.450.000	Huarong Finance 2017 4,75% 27/4/2027*	1.925.933	0,07
				USD 7.562.000	Huarong Finance 2019 3,25% 13/11/2024*	6.918.549	0,25
				USD 2.229.000	Huarong Finance 2019 3,75% 29/5/2024*	2.106.405	0,08
				USD 12.450.000	Huarong Finance 2019 6,895% 24/2/2025	11.324.022	0,41
				USD 3.027.000	Huarong Finance II 4,625% 3/6/2026	2.514.665	0,09
				USD 2.750.000	Huarong Finance II 5% 19/11/2025	2.378.750	0,09
				USD 19.530.000	Inventive Global Investments 1,65% 3/9/2025	17.941.820	0,64
				USD 9.905.000	JIC Zhixin 2,125% 27/8/2030	8.145.971	0,29
				HKD 3.000.000	Link CB 1,6% 3/4/2024	371.511	0,01
COMPARTIMENTS							
Luxembourg							
1.192.840	BlackRock Global Funds - China Onshore Bond Fund**	16.694.345	0,60				
572.094	BlackRock Global Funds - Sustainable Asian Bond Fund**	5.057.310	0,18				
		21.751.655	0,78				
Singapour							
8.035.000	iShares USD Asia High Yield Bond Index ETF~	47.727.900	1,71				
Total des Compartiments		69.479.555	2,49				
OBLIGATIONS							
Australie							
USD 1.800.000	Australia & New Zealand Banking 4,4% 19/5/2026	1.727.907	0,06				
USD 8.000.000	Commonwealth Bank of Australia 2,688% 11/3/2031	6.273.300	0,23				
USD 7.500.000	Commonwealth Bank of Australia 3,784% 14/3/2032*	6.250.248	0,22				
USD 1.800.000	Macquarie Bank 4,875% 10/6/2025	1.755.062	0,06				
USD 2.400.000	National Australia Bank 2,332% 21/8/2030	1.870.917	0,07				
USD 3.000.000	National Australia Bank 2,99% 21/5/2031*	2.396.348	0,09				
		20.273.782	0,73				
Bermudes							
USD 742.000	Hopson Development 7% 18/5/2024*	558.281	0,02				
USD 7.500.000	Kunlun Energy 3,75% 13/5/2025*	7.274.550	0,26				
USD 3.819.000	Luye Pharma 6,25% 6/7/2028	3.430.752	0,12				
USD 14.875.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4,85% 14/10/2038	13.088.289	0,47				
		24.351.872	0,87				
Îles Vierges britanniques							
USD 2.700.000	Amipeace 1,5% 22/10/2025*	2.481.205	0,09				
USD 9.205.000	Bluestar Finance 3,1% 12/7/2024	8.951.299	0,32				
USD 5.000.000	Chalco Hong Kong Investment 2,1% 28/7/2026	4.537.875	0,16				
USD 3.366.000	Champion Path 4,5% 27/1/2026	2.982.562	0,11				
EUR 6.175.000	Cheung Kong Infrastructure Finance BVI 1% 12/12/2024*	6.368.178	0,23				
USD 3.925.000	China Cinda 2020 I Management 1,875% 20/1/2026	3.525.769	0,13				
USD 5.847.000	China Cinda 2020 I Management 3,25% 28/1/2027	5.319.133	0,19				
USD 3.530.000	China Cinda 2020 I Management 5,75% 7/2/2027*	3.473.414	0,12				
USD 2.900.000	China Cinda Finance 2015 I 4,25% 23/4/2025*	2.796.151	0,10				
USD 1.475.000	China Cinda Finance 2017 I 4,375% 8/2/2025	1.431.945	0,05				

∞ Participation croisée d'un fonds à compartiments multiples et investissement dans le fonds d'une partie liée, pour de plus amples informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

~ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Asian Tiger Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 1.300.000	New Metro Global 4,5% 2/5/2026	352.001	0,01	USD 8.900.000	Alibaba 3,15% 9/2/2051*	5.385.167	0,19
USD 926.000	New Metro Global 4,625% 15/10/2025	275.518	0,01	USD 4.800.000	Alibaba 3,25% 9/2/2061*	2.772.744	0,10
USD 1.200.000	New Metro Global 4,8% 15/12/2024	472.176	0,02	USD 13.697.000	Alibaba 4% 6/12/2037	11.120.526	0,40
USD 7.850.000	NWD Finance BVI 4,125% 10/3/2028	3.900.626	0,14	USD 7.000.000	Avi Funding 3,8% 16/9/2025*	6.779.010	0,24
USD 8.815.000	Ocean Laurel 2,375% 20/10/2025	8.105.833	0,29	USD 4.056.000	Baidu 1,72% 9/4/2026*	3.669.524	0,13
USD 200.000	Oriental Capital 7% 28/9/2025*	189.488	0,01	USD 6.800.000	Baidu 4,375% 29/3/2028*	6.517.528	0,23
USD 11.650.000	Peak RE Bvi 5,35% 28/10/2025	9.760.253	0,35	USD 15.510.000	CCBL Cayman 1 1,6% 15/9/2026	13.822.279	0,49
USD 850.000	RKPF Overseas 2019 A 5,9% 5/3/2025*	477.245	0,02	USD 2.000.000	CCBL Cayman 1 1,99% 21/7/2025	1.867.710	0,07
USD 600.000	RKPF Overseas 2019 A 6% 4/9/2025	279.000	0,01	USD 15.600.000	CDBL Funding 1 3,5% 24/10/2027	14.623.752	0,52
USD 4.563.000	SF Investment 2,875% 20/2/2030*	3.916.058	0,14	USD 6.194.000	CDBL Funding 2 1,375% 4/3/2024	6.053.025	0,22
USD 2.000.000	SF Investment 2021 2,375% 17/11/2026	1.811.730	0,06	USD 16.400.000	CDBL Funding 2 2,75% 2/3/2025*	15.692.340	0,56
USD 3.693.000	SF Investment 2021 3,125% 17/11/2031*	3.107.789	0,11	USD 1.273.000	China Aoyuan 6,35% 8/2/2024	38.190	0,00
USD 1.000.000	SFG International 2,4% 3/6/2026	898.015	0,03	USD 2.413.000	China Aoyuan 7,95% 19/2/2023***	72.390	0,00
USD 23.000.000	Sinochem Offshore Capital 2,25% 24/11/2026*	20.616.855	0,74	USD 6.400.000	China Modern Dairy 2,125% 14/7/2026	5.511.680	0,20
USD 6.350.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance II 5,95% 4/2/2027*	571.500	0,02	USD 10.945.000	China Resources Land 3,75% 9/12/2024*	10.451.818	0,37
USD 2.800.000	Sino-Ocean Land Treasure IV 2,7% 13/1/2025	336.910	0,01	EUR 4.292.000	CK Hutchison Europe Finance 18 2% 13/4/2030*	4.079.588	0,14
USD 3.324.280	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033	3.242.470	0,12	EUR 4.000.000	CK Hutchison Europe Finance 21 0,75% 2/11/2029	3.537.138	0,13
USD 13.000.000	Studio City 7% 15/2/2027	12.341.615	0,44	USD 18.850.000	CK Hutchison International 23 4,75% 21/4/2028*	18.375.545	0,66
USD 3.400.000	Studio City Finance 5% 15/1/2029*	2.558.007	0,09	USD 26.700.000	CK Hutchison International 23 4,875% 21/4/2033*	25.741.470	0,92
USD 9.000.000	Studio City Finance 6% 15/7/2025*	8.478.765	0,30	USD 3.735.000	Country Garden 2,7% 12/7/2026	326.813	0,01
USD 19.971.000	Sunny Express Enterprises 3,125% 23/4/2030*	17.777.086	0,64	USD 4.500.000	Country Garden 3,125% 22/10/2025	405.000	0,02
EUR 3.482.000	Talent Yield Euro 1% 24/9/2025	3.484.491	0,13	USD 1.200.000	Country Garden 3,3% 12/1/2031	96.000	0,00
USD 16.940.000	TCL Technology Investments 1,875% 14/7/2025*	15.651.289	0,56	USD 818.000	Country Garden 3,875% 22/10/2030	65.186	0,00
USD 9.000.000	TSMC Global 1,375% 28/9/2030	7.043.895	0,25	USD 1.350.000	Country Garden 4,2% 6/2/2026	117.437	0,00
USD 6.300.000	TSMC Global 2,25% 23/4/2031	5.191.672	0,19	USD 7.226.000	Country Garden 4,8% 6/8/2030	578.080	0,02
USD 1.500.000	Vertex Capital Investment 4,75% 3/4/2024	1.475.835	0,06	USD 6.900.000	Country Garden 5,125% 14/1/2027	568.180	0,02
USD 900.000	Wanda Properties Global 11% 13/2/2026	353.025	0,01	USD 500.000	Country Garden 5,625% 15/12/2026	43.758	0,00
USD 4.255.000	Wharf REIC Finance BVI 2,875% 7/5/2030*	3.624.856	0,13	USD 200.000	Country Garden 5,625% 14/1/2030	16.046	0,00
USD 1.449.000	Yunda Investment 2,25% 19/8/2025	1.293.508	0,05	USD 500.000	Country Garden 7,25% 8/4/2026	43.750	0,00
		312.586.151	11,20	USD 2.000.000	Doha Finance 2,375% 31/3/2026	1.837.480	0,06
	Îles Caïmans			USD 1.400.000	EMG SUKUK 4,564% 18/6/2024	1.377.971	0,05
USD 2.300.000	AAC Technologies 3,75% 2/6/2031*	1.533.019	0,06	USD 8.000.000	ENN Energy 4,625% 17/5/2027*	7.792.831	0,28
USD 690.000	AC Energy Finance International 5,1% 25/11/2025	534.508	0,02	USD 6.500.000	ESR 1,5% 30/9/2025	6.443.125	0,23
USD 4.035.000	Agile 5,5% 21/4/2025	504.375	0,02	USD 16.875.000	Fantasia 9,875% 19/10/2023	843.750	0,03
USD 1.100.000	Agile 5,5% 17/5/2026	111.337	0,00	USD 8.000.000	Fantasia 10,875% 2/3/2024	400.000	0,01
USD 200.000	Agile 5,75% 2/1/2025	29.628	0,00	USD 5.000.000	Fantasia 11,75% 17/4/2022***	250.000	0,01
USD 2.442.000	Agile 6,05% 13/10/2025	280.830	0,01	USD 8.660.000	Fantasia 11,875% 1/6/2023***	433.000	0,02
USD 4.800.000	Alibaba 2,7% 9/2/2041*	3.074.196	0,11	USD 8.200.000	FWD 5,75% 9/7/2024	8.018.575	0,29
				USD 8.500.000	Gaci First Investment 4,875% 14/2/2035	8.033.520	0,29
				USD 1.200.000	Greentown China 5,65% 13/7/2025*	969.000	0,04
				USD 8.255.000	Haidilao International 2,15% 14/1/2026*	7.470.775	0,27
				USD 3.300.000	Hansoh Pharmaceutical 0% 22/1/2026	3.198.921	0,11

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Tiger Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 6.300.000	Hutchison Whampoa International 03/33 7,45% 24/11/2033	7.244.181	0,26				
USD 1.900.000	Link Finance Cayman 2009 2,75% 19/1/2032*	1.556.898	0,06				
USD 3.146.000	Longfor 3,85% 13/1/2032	1.712.761	0,06				
USD 2.570.000	Longfor 3,95% 16/9/2029*	1.524.408	0,06				
USD 600.000	Longfor 4,5% 16/1/2028*	392.409	0,01				
USD 25.600.000	Meituan 0% 27/4/2027	22.656.000	0,81				
USD 20.626.000	Meituan 3,05% 28/10/2030*	16.304.647	0,58				
USD 11.800.000	Melco Resorts Finance 4,875% 6/6/2025*	11.206.283	0,40				
USD 2.700.000	Melco Resorts Finance 5,25% 26/4/2026*	2.511.000	0,09				
USD 5.300.000	Melco Resorts Finance 5,625% 17/7/2027*	4.781.051	0,17				
USD 8.725.000	Melco Resorts Finance 5,75% 21/7/2028	7.739.991	0,28				
USD 5.640.000	MGM China 5,25% 18/6/2025	5.426.159	0,19				
USD 21.000.000	MGM China 5,375% 15/5/2024	20.714.400	0,74				
USD 5.800.000	OmGrid Funding 5,196% 16/5/2027	5.551.673	0,20				
USD 2.000.000	PCGI Intermediate 4,75% 28/10/2024	1.882.500	0,07				
USD 7.846.660	Pearl II 6% 2/10/2023	215.862	0,01				
USD 900.000	Sands China 2,8% 8/3/2027*	780.606	0,03				
USD 3.000.000	Sands China 3,35% 8/3/2029*	2.490.765	0,09				
USD 2.500.000	Sands China 4,3% 8/1/2026	2.342.000	0,08				
USD 6.900.000	Sands China 5,375% 8/8/2025*	6.682.271	0,24				
USD 20.750.000	Sands China 5,65% 8/8/2028*	19.541.831	0,70				
USD 930.000	Seazen 4,45% 13/7/2025	289.965	0,01				
USD 793.000	Seazen 6% 12/8/2024*	420.290	0,02				
USD 2.460.000	Shui On Development 5,5% 29/6/2026*	1.119.300	0,04				
USD 800.000	Shui On Development 6,15% 24/8/2024*	534.392	0,02				
USD 10.167.000	Sinic 8,5% 24/1/2022***	135.729	0,01				
USD 6.000.000	Sinic 9,5% 18/10/2021***	31.500	0,00				
USD 2.960.000	Sunac China 5,95% 26/4/2024***	325.600	0,01				
USD 2.595.000	Sunac China 6,5% 9/7/2023***	285.450	0,01				
USD 830.000	Sunac China 6,65% 3/8/2024	91.300	0,00				
USD 500.000	Sunac China 6,8% 20/10/2024***	55.000	0,00				
USD 500.000	Sunac China 7% 9/7/2025	55.000	0,00				
USD 2.390.000	Sunac China 7,95% 11/10/2023***	262.900	0,01				
USD 1.800.000	Swire Pacific MTN Financing 3,875% 21/9/2025	1.736.865	0,06				
USD 6.000.000	Tencent 2,39% 3/6/2030*	4.931.250	0,18				
USD 6.000.000	Tencent 2,88% 22/4/2031	5.004.570	0,18				
USD 25.950.000	Tencent 3,24% 3/6/2050	15.907.220	0,57				
USD 12.688.000	Tencent 3,68% 22/4/2041*	9.252.280	0,34				
USD 7.301.000	Tencent 3,925% 19/1/2038	5.785.276	0,21				
USD 19.700.000	Tencent 3,975% 11/4/2029*	18.125.379	0,65				
USD 8.030.000	Tingyi Cayman Islands 1,625% 24/9/2025*	7.390.491	0,26				
USD 11.350.000	Weibo 3,375% 8/7/2030*	8.891.136	0,31				
USD 17.500.000	Wynn Macau 4,875% 1/10/2024*	17.061.363	0,61				
USD 1.000.000	Wynn Macau 5,125% 15/12/2029*	819.315	0,03				
USD 15.200.000	Wynn Macau 5,5% 15/1/2026	14.266.796	0,51				
USD 6.800.000	Wynn Macau 5,5% 1/10/2027*	6.098.240	0,22				
USD 4.400.000	Wynn Macau 5,625% 26/8/2028*	3.865.202	0,14				
USD 3.586.000	Zhongsheng 3% 13/1/2026*	3.281.531	0,12				
		480.789.551	17,20				
					Chine		
USD 475.000	Agricultural Bank of China 1,2% 22/10/2025*	434.578	0,02				
USD 2.950.000	Bank of China 3,875% 30/6/2025	2.868.580	0,10				
USD 19.600.000	Bank of China 4,75% 23/11/2025*	19.315.996	0,69				
USD 14.930.000	China Life Insurance Overseas 5,35% 15/8/2033	14.740.802	0,53				
CNY 20.000.000	Chongqing Longhu Development 3,7% 9/12/2036	2.532.665	0,09				
USD 4.000.000	Chongqing Nan'an Urban Construction & Development 4,66% 4/6/2024	3.911.500	0,14				
USD 7.275.000	Guoren Property & Casualty Insurance 3,35% 1/6/2026	6.266.430	0,22				
USD 500.000	Henan Water Conservancy Investment 2,8% 18/9/2025	466.385	0,02				
USD 1.000.000	Jinan Hi-tech 2,8% 22/11/2024	953.470	0,03				
USD 2.000.000	Kunming Rail Transit 8,5% 7/12/2025	1.648.981	0,06				
CNH 10.000.000	Pharmaron Beijing 0% 18/6/2026	1.352.498	0,05				
USD 2.000.000	Pharmaron Beijing 0% 18/6/2026	1.847.500	0,07				
USD 2.060.000	Sunshine Life Insurance 4,5% 20/4/2026*	1.834.955	0,07				
USD 1.550.000	Taizhou Urban Construction and Investment Development 2,05% 2/9/2024	1.474.639	0,05				
USD 3.500.000	Tianjin Rail Transit Urban Development 6,2% 25/9/2023	3.491.250	0,13				
USD 800.000	Wuhan Urban Construction 2,25% 9/7/2024	771.908	0,03				
USD 600.000	Zhengzhou Urban Construction Investment 3,8% 16/1/2025	575.079	0,02				
USD 13.318.000	ZhongAn Online P&C Insurance 3,125% 16/7/2025	11.690.274	0,42				
USD 3.415.000	ZhongAn Online P&C Insurance 3,5% 8/3/2026	2.909.939	0,10				
		79.087.429	2,84				
					France		
SGD 8.000.000	Credit Agricole 5,25% 7/9/2033	5.918.087	0,21				
					Hong Kong		
USD 8.500.000	Airport Authority 3,25% 12/1/2052*	6.158.760	0,22				
USD 4.600.000	Bank of Communications Hong Kong 2,304% 8/7/2031	4.180.273	0,15				
USD 5.547.000	Bank of East Asia 5,825% 21/10/2025	4.284.198	0,15				
USD 1.500.000	Bank of East Asia 5,875% 19/9/2024*	1.246.147	0,04				
USD 6.000.000	Bank of East Asia 6,75% 15/3/2027*	5.892.390	0,21				
USD 20.000.000	Blossom Joy 2,2% 21/10/2030*	16.546.000	0,59				
USD 6.250.000	China Taiping Insurance 6,4% 9/3/2028*	6.390.156	0,23				
USD 3.300.000	Chong Hing Bank 5,5% 3/8/2025	3.114.903	0,11				
USD 12.790.000	CITIC 2,85% 25/2/2030	11.104.150	0,40				
USD 1.800.000	CITIC 4% 11/1/2028	1.713.996	0,06				
USD 8.000.000	CNAC HK Finbridge 5,125% 14/3/2028*	7.786.280	0,28				
USD 4.950.000	Dah Sing Bank 3% 2/11/2031	4.314.717	0,15				
USD 4.600.000	Far East Horizon 2,625% 3/3/2024*	4.320.458	0,15				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Asian Tiger Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.300.000	Gemdale Ever Prosperity Investment 4,95% 12/8/2024	454.662	0,02	USD 4.774.000	GMR Hyderabad International Airport 4,25% 27/10/2027	4.263.158	0,15
USD 4.165.000	GLP China 2,95% 29/3/2026*	2.383.338	0,08	USD 3.450.000	GMR Hyderabad International Airport 4,75% 2/2/2026*	3.293.422	0,12
USD 1.000.000	Hainan State Farms International HK 3% 3/2/2024	973.910	0,04	USD 4.910.000	HDFC Bank 3,7% 25/8/2026*	4.266.790	0,15
USD 3.000.000	Hongkong International Qingdao 4% 8/10/2024	2.924.795	0,10	INR 2.518.600.000	HDFC Bank 7,65% 25/5/2033	30.535.032	1,09
USD 1.500.000	Huatong International Investment 2,98% 4/3/2024	1.465.440	0,05	USD 382.000	Muthoot Finance 4,4% 2/9/2023	381.962	0,01
USD 8.400.000	ICBCIL Finance 1,75% 25/8/2025*	7.776.132	0,28	EUR 5.779.000	NTPC 2,75% 1/2/2027	5.871.164	0,21
USD 15.850.000	ICBCIL Finance 2,25% 2/11/2026*	14.367.629	0,51	USD 9.900.000	Oil & Natural Gas 3,375% 5/12/2029*	8.746.699	0,31
USD 11.100.000	Lenovo 3,421% 2/11/2030*	9.255.347	0,33	USD 5.200.000	Oil India 5,125% 4/2/2029	5.089.526	0,18
USD 4.699.000	Minsheng Hong Kong International Leasing Via Landmark Funding 2020 3,15% 10/3/2024	4.550.394	0,16	USD 1.400.000	ONGC Videsh 4,625% 15/7/2024	1.384.285	0,05
USD 2.100.000	Nanyang Commercial Bank 3,8% 20/11/2029	2.017.302	0,07	EUR 6.334.000	Power Finance 1,841% 21/9/2028	5.790.727	0,21
USD 6.680.000	Pingan Real Estate Capital 2,75% 29/7/2024*	5.344.000	0,19	USD 8.671.000	Power Finance 3,75% 6/12/2027*	8.002.596	0,29
USD 200.000	SCI HK Development 2,95% 30/3/2024	194.602	0,01	USD 8.322.000	Power Finance 3,9% 16/9/2029*	7.435.208	0,27
USD 950.000	Shanghai Hong Kong International Investments 5% 16/6/2025	883.082	0,03	USD 5.721.000	Power Finance 4,5% 18/6/2029*	5.323.848	0,19
USD 3.900.000	Vanke Real Estate Hong Kong 3,15% 12/5/2025*	3.266.250	0,12	USD 10.200.000	REC 2,25% 1/9/2026*	9.221.667	0,33
USD 3.600.000	Vanke Real Estate Hong Kong 3,975% 9/11/2027*	2.760.228	0,10	USD 700.000	REC 3,5% 12/12/2024	677.362	0,02
USD 5.845.000	Yango Justice International 7,5% 15/4/2024***	87.675	0,00	USD 23.969.000	REC 3,875% 7/7/2027	22.301.836	0,80
USD 8.143.000	Yango Justice International 7,5% 17/2/2025***	122.145	0,01	USD 9.750.000	Reliance Industries 3,625% 12/1/2052*	6.667.343	0,24
USD 12.155.000	Yango Justice International 7,875% 4/9/2024	182.325	0,01	USD 11.000.000	Reliance Industries 3,667% 30/11/2027*	10.325.150	0,37
USD 10.535.000	Yango Justice International 8,25% 25/11/2023***	158.025	0,01	USD 11.675.000	Shriram Finance 4,4% 13/3/2024*	11.491.411	0,41
USD 1.500.000	Yanlord Land HK 5,125% 20/5/2026*	858.750	0,03	USD 14.150.000	Summit Digital Infrastructure 2,875% 12/8/2031*	11.145.248	0,40
USD 1.478.000	Zhejiang Seaport International 1,98% 17/3/2026*	1.351.350	0,05	USD 17.000.000	UltraTech Cement 2,8% 16/2/2031	13.760.905	0,49
		138.429.809	4,94			217.757.783	7,79
	Inde				Indonésie		
USD 4.000.000	Adani Electricity Mumbai 3,949% 12/2/2030*	2.958.300	0,11	USD 700.000	Bank Mandiri Persero 4,75% 13/5/2025	688.625	0,02
USD 2.300.000	Adani Green Energy 4,375% 8/9/2024	2.151.604	0,08	USD 3.458.000	Bank Negara Indonesia Persero 3,75% 30/3/2026	3.220.522	0,12
USD 4.600.000	Adani Green Energy UP / Prayatna Developers Pvt / Parampujya Solar Energy 6,25% 10/12/2024*	4.368.965	0,16	USD 7.637.000	Bank Tabungan Negara Persero 4,2% 23/1/2025*	7.256.677	0,26
USD 2.000.000	Adani Ports & Special Economic Zone 4% 30/7/2027	1.676.690	0,06	USD 13.980.000	Freeport Indonesia 5,315% 14/4/2032*	13.017.757	0,47
USD 10.000.000	Adani Ports & Special Economic Zone 4,2% 4/8/2027*	8.430.550	0,30	USD 5.000.000	Hutama Karya Persero 3,75% 11/5/2030	4.523.525	0,16
USD 6.000.000	Adani Ports & Special Economic Zone 4,375% 3/7/2029	4.786.830	0,17	USD 9.700.000	Indonesia Government International Bond 1,85% 12/3/2031	7.785.026	0,28
USD 9.000.000	Adani Transmission Step-One 4% 3/8/2026*	7.875.765	0,28	USD 2.556.000	Indonesia Government International Bond 3,5% 14/2/2050*	1.888.744	0,07
USD 862.000	Axis Bank 4,1% 8/9/2026*	751.797	0,03	USD 7.667.000	Indonesia Government International Bond 3,55% 31/3/2032	6.831.924	0,24
USD 9.300.000	Export-Import Bank of India 3,375% 5/8/2026	8.781.943	0,31	USD 6.800.000	Indonesia Government International Bond 3,7% 30/10/2049*	5.204.924	0,19
				USD 14.700.000	Indonesia Government International Bond 4,35% 11/1/2048*	12.609.807	0,45
				USD 16.000.000	Indonesia Government International Bond 4,65% 20/9/2032	15.476.960	0,55
				USD 15.078.000	Indonesia Government International Bond 4,75% 18/7/2047*	13.883.521	0,50

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Tiger Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 10.000.000	LG Chem 2,375% 7/7/2031*	8.047.591	0,29	USD 3.200.000	Thaioil Treasury Center 3,5% 17/10/2049	1.975.824	0,07
USD 4.500.000	LOTTE Property & Development 4,5% 1/8/2025*	4.398.255	0,16	USD 3.200.000	Thaioil Treasury Center 3,75% 18/6/2050	2.055.808	0,07
USD 10.000.000	Mirae Asset 2,625% 30/7/2025*	9.291.550	0,33	USD 2.600.000	Thaioil Treasury Center 4,625% 20/11/2028*	2.470.364	0,09
USD 2.000.000	NAVER 1,5% 29/3/2026	1.796.000	0,06	USD 6.000.000	TMBThanachart Bank 4,9% 2/12/2024*	5.782.500	0,21
USD 1.600.000	NongHyup Bank 1,25% 20/7/2025	1.477.824	0,05			84.611.035	3,03
USD 7.000.000	NongHyup Bank 4% 6/1/2026	6.769.945	0,24	Émirats arabes unis			
USD 5.900.000	POSCO 5,625% 17/1/2026*	5.905.457	0,21	USD 7.500.000	Masdar Abu Dhabi Future Energy 4,875% 25/7/2033	7.328.738	0,26
USD 13.300.000	POSCO 5,75% 17/1/2028*	13.397.223	0,48	USD 6.850.000	MDGH GMTN RSC 5,084% 22/5/2053*	6.488.258	0,23
USD 14.750.000	Shinhan Bank 3,875% 24/3/2026*	13.945.977	0,50			13.816.996	0,49
USD 10.000.000	Shinhan Card 2,5% 27/1/2027	9.023.400	0,32	Royaume-Uni			
USD 5.700.000	Shinhan Financial 2,875% 12/5/2026*	5.032.502	0,18	USD 4.900.000	HSBC 5,887% 14/8/2027*	4.882.922	0,18
USD 15.000.000	Shinhan Financial 5% 24/7/2028	14.746.666	0,53	USD 5.000.000	HSBC 6,161% 9/3/2029	5.035.210	0,18
USD 8.146.000	SK Hynix 1,5% 19/1/2026	7.332.459	0,26	USD 4.765.000	HSBC 6,332% 9/3/2044	4.814.139	0,17
USD 8.500.000	SK Hynix 2,375% 19/1/2031*	6.590.772	0,24	USD 9.300.000	HSBC 6,375% 30/3/2025*	8.977.058	0,32
USD 8.600.000	SK Hynix 6,25% 17/1/2026*	8.635.518	0,31	USD 10.000.000	HSBC 6,547% 20/6/2034*	9.789.158	0,35
USD 9.325.000	SK Hynix 6,375% 17/1/2028*	9.436.620	0,34	USD 4.900.000	HSBC 6,905% 14/8/2027	4.921.871	0,18
USD 2.500.000	SK Hynix 6,5% 17/1/2033	2.534.388	0,09	USD 3.675.000	HSBC 8% 7/3/2028	3.675.225	0,13
USD 3.690.000	SK On 5,375% 11/5/2026*	3.675.960	0,13	EUR 3.750.000	Jaguar Land Rover Automotive 5,875% 15/11/2024*	4.092.020	0,15
USD 19.100.000	Tongyang Life Insurance 5,25% 22/9/2025*	17.012.847	0,61	USD 8.774.000	Standard Chartered 2,678% 29/6/2032	6.907.656	0,25
		315.067.901	11,28	USD 1.640.000	Standard Chartered 4,644% 1/4/2031	1.515.130	0,05
Sri Lanka				USD 10.000.000	Standard Chartered 6,17% 9/1/2027*	10.028.450	0,36
USD 16.000.000	Sri Lanka Government International Bond 5,75% 18/4/2023***	7.495.520	0,27	USD 23.500.000	Standard Chartered 6,296% 6/7/2034*	23.404.757	0,84
USD 270.000	Sri Lanka Government International Bond 6,125% 3/6/2025	128.685	0,01	USD 20.000.000	Standard Chartered 6,301% 9/1/2029*	20.167.100	0,72
USD 3.110.000	Sri Lanka Government International Bond 6,35% 28/6/2024	1.451.126	0,05	USD 19.299.000	Vedanta Resources Finance II 8,95% 11/3/2025	12.659.179	0,45
USD 4.729.000	Sri Lanka Government International Bond 6,825% 18/7/2026	2.236.273	0,08	USD 1.000.000	Vedanta Resources Finance II 13,875% 21/1/2024	860.750	0,03
USD 4.051.000	Sri Lanka Government International Bond 6,85% 14/3/2024	1.887.442	0,07			121.730.625	4,36
USD 17.370.000	Sri Lanka Government International Bond 6,85% 3/11/2025	8.212.970	0,29	États-Unis			
USD 800.000	Sri Lanka Government International Bond 7,55% 28/3/2030	362.416	0,01	USD 10.125.000	Hanwha Energy USA 4,125% 5/7/2025	9.808.746	0,35
		21.774.432	0,78	USD 20.000.000	Hanwha Q Cells Americas 5% 27/7/2028	19.797.047	0,71
Thaïlande				USD 6.000.000	Nissan Motor Acceptance 2,75% 9/3/2028	5.059.730	0,18
USD 7.800.000	Bangkok Bank 3,466% 23/9/2036*	6.273.228	0,22	USD 10.700.000	Resorts World Las Vegas / RWLV Capital 4,625% 16/4/2029*	8.766.510	0,31
USD 20.844.000	Kasikornbank 3,343% 2/10/2031	18.704.051	0,67	USD 4.500.000	SK Battery America 1,625% 26/1/2024*	4.408.942	0,16
USD 2.350.000	Kasikornbank 4% 10/2/2027*	2.027.657	0,07			47.840.975	1,71
USD 8.000.000	Kasikornbank 5,458% 7/3/2028*	7.990.760	0,29	Vietnam			
USD 28.665.000	Minor International 2,7% 19/4/2026*	26.169.712	0,94	USD 2.649.000	BIM Land JSC 7,375% 7/5/2026	1.885.280	0,07
USD 2.498.000	Muang Thai Life Assurance 3,552% 27/1/2037	2.219.723	0,08	Total des obligations		2.601.658.673	93,11
USD 11.150.000	Thaioil Treasury Center 2,5% 18/6/2030*	8.941.408	0,32	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		2.671.138.228	95,60

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Asian Tiger Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Autres titres négociables			
OBLIGATIONS			
	Hong Kong		
CNH 2.989.562	China City Construction International 5,35% 3/7/2017***,***	-	0,00
Total des obligations		-	0,00
Total des autres valeurs mobilières		-	0,00
Total du portefeuille		2.671.138.228	95,60
Autres éléments de l'actif net		122.872.149	4,40
Total de l'actif net (USD)		2.794.010.377	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
CNH	25.882.165	USD	3.607.371	BNP Paribas	20/9/2023	(46.912)
CNH	24.700.000	USD	3.390.515	Goldman Sachs	20/9/2023	7.320
CNH	12.500.000	USD	1.715.609	BNY Mellon	20/9/2023	3.944
HKD	9.800.000	USD	1.250.575	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(74)
IDR	209.000.000.000	USD	13.965.920	HSBC Bank	17/10/2023	(252.287)
IDR	241.312.650.000	USD	15.818.594	BNP Paribas	17/10/2023	15.250
INR	110.000.000	USD	1.327.941	Bank of America	20/9/2023	733
JPY	205.000.000	USD	1.415.651	Nomura	20/9/2023	(9.433)
KRW	10.000.000.000	USD	7.610.350	Deutsche Bank	13/12/2023	(11.129)
MYR	120.946.500	USD	26.575.808	Goldman Sachs	17/10/2023	(431.916)
MYR	120.946.500	USD	26.581.648	Barclays	17/10/2023	(437.757)
SGD	1.500.000	USD	1.108.692	HSBC Bank	20/9/2023	1.817
SGD	1.500.000	USD	1.109.799	JP Morgan	20/9/2023	710
USD	7.840.063	KRW	10.000.000.000	Bank of America	13/12/2023	240.842
USD	55.302.472	MYR	241.893.000	Barclays	17/10/2023	3.014.690
USD	30.303.678	IDR	450.312.650.000	HSBC Bank	17/10/2023	756.200
USD	3.183.235	JPY	450.000.000	Morgan Stanley	20/9/2023	96.414
USD	3.043.752	HKD	23.746.472	Goldman Sachs	20/9/2023	13.651
USD	66.300.091	EUR	60.300.000	Goldman Sachs	20/9/2023	827.199
USD	11.319.933	SGD	15.145.120	Goldman Sachs	20/9/2023	107.410
USD	31.935.887	INR	2.646.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(24.758)
USD	29.478.929	CNH	213.000.000	HSBC Bank	20/9/2023	177.756
USD	4.348.401	EUR	4.000.000	Citigroup	20/9/2023	5.257
USD	1.087.568	EUR	1.000.000	RBS	20/9/2023	1.782
USD	148.346	SGD	200.000	Citigroup	20/9/2023	278
Plus-value nette non réalisée						4.056.987
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	144.910.477	USD	94.382.006	BNY Mellon	15/9/2023	(477.804)
USD	3.642.717	AUD	5.649.396	BNY Mellon	15/9/2023	(18.164)
Moins-value nette non réalisée						(495.968)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	51.934.730	USD	38.621.257	BNY Mellon	15/9/2023	(225.805)
USD	1.885.588	CAD	2.545.884	BNY Mellon	15/9/2023	3.410
Moins-value nette non réalisée						(222.395)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Tiger Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	62.427.401	USD	71.483.399	BNY Mellon	15/9/2023	(715.548)
USD	7.401.929	CHF	6.491.194	BNY Mellon	15/9/2023	43.531
Moins-value nette non réalisée						(672.017)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	334.710.103	USD	46.387.177	BNY Mellon	15/9/2023	(354.753)
USD	2.372.864	CNY	17.207.963	BNY Mellon	15/9/2023	6.272
Moins-value nette non réalisée						(348.481)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	252.933.692	USD	277.531.531	BNY Mellon	15/9/2023	(2.964.562)
USD	48.984.935	EUR	45.094.358	BNY Mellon	15/9/2023	33.946
Moins-value nette non réalisée						(2.930.616)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	89.274.024	USD	113.591.694	BNY Mellon	15/9/2023	(417.794)
USD	4.216.348	GBP	3.316.095	BNY Mellon	15/9/2023	12.490
Moins-value nette non réalisée						(405.304)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	1.206.237.715	USD	154.562.382	BNY Mellon	15/9/2023	(681.007)
USD	7.147.219	HKD	55.904.346	BNY Mellon	15/9/2023	15.435
Moins-value nette non réalisée						(665.572)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	35.449.328	USD	21.417.562	BNY Mellon	15/9/2023	(333.530)
USD	1.698.967	NZD	2.860.439	BNY Mellon	15/9/2023	(2.322)
Moins-value nette non réalisée						(335.852)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	13.596	SGD	18.406	BNY Mellon	5/9/2023	(22)
SGD	366.525.575	USD	272.301.072	BNY Mellon	15/9/2023	(1.008.941)
USD	7.063.395	SGD	9.573.806	BNY Mellon	15/9/2023	(22.849)
Moins-value nette non réalisée						(1.031.812)
Catégorie d'Actions couverte en ZAR						
USD	226.237	ZAR	4.310.451	BNY Mellon	15/9/2023	(2.945)
ZAR	89.030.139	USD	4.720.329	BNY Mellon	15/9/2023	13.262
Plus-value nette non réalisée						10.317
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.514.692.601)						(3.040.713)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(20)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	20.108.793	(60.210)
(282)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	31.271.156	(251.156)
(520)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	60.311.875	(536.234)
648	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	83.895.750	922.725
1.159	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	236.055.702	575.716
149	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	15.913.898	94.289
Total				447.557.174	745.130

Asian Tiger Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR (20.000.000)	Fund provides default protection on HSBC; and receives Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	50.372	223.611
CDS	USD (12.250.000)	Fund provides default protection on Philippines; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	88.799	151.680
CDS	USD (39.400.000)	Fund provides default protection on Indonesia; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	249.773	404.344
CDS	USD (45.000.000)	Fund provides default protection on Indonesia; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	75.718	356.505
CDS	USD (20.000.000)	Fund provides default protection on ITRAXX.AUST.39.V1; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	57.843	190.780
CDS	USD (97.000.000)	Fund provides default protection on ITRX ASIAXJ IG S39; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	34.937	(1.189.445)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 235.357.000)					557.442	137.475

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
166	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.700	15/9/2023	(173.916)	29.631
214	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.800	15/9/2023	(191.873)	24.557
105	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.300	20/10/2023	(780.207)	232.575
93	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.350	20/10/2023	(317.176)	259.470
380	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.800	17/11/2023	29.906	360.960
87	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.100	17/11/2023	(198.331)	175.305
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 21.729.251)						(1.631.597)	1.082.498

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(380)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.500	15/9/2023	79.647	(2.423)
(105)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.000	20/10/2023	422.637	(70.350)
(93)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.100	20/10/2023	196.977	(88.350)
(380)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.600	17/11/2023	6.637	(70.254)
(87)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3.700	17/11/2023	66.736	(63.510)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 6.771.740)						772.634	(294.887)

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
USD 132.300.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.ASIA.XJ.IG.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 1% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	(249.081)	412.419
EUR 67.000.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.XO.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	(488.726)	46.029
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 104.743.706)				(737.807)	458.448

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Asian Tiger Bond Fund suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
USD (147.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.ASIA.XJ.IG.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 1% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	243.129	(28.821)
EUR (67.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.XO.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	254.025	(21.765)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 52.730.965)				497.154	(50.586)

Brown To Green Materials Fund⁽²⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie				Japon			
19.222	BHP	558.431	2,73	13.500	Shin-Etsu Chemical	430.341	2,11
57.687	Calix	143.489	0,70	Luxembourg			
73.098	Champion Iron	288.357	1,41	18.762	ArcelorMittal	501.769	2,46
109.041	Develop Global	199.181	0,98	Norvège			
41.905	IGO	377.845	1,85	80.354	Norsk Hydro	448.370	2,19
62.737	Lynas Rare Earths	292.187	1,43	Corée du Sud			
12.033	Mineral Resources	557.533	2,73	1.267	LG Chem	558.851	2,74
54.164	Orica	551.183	2,70	Suède			
132.517	Pilbara Minerals	400.864	1,96	34.725	Epiroc	670.357	3,28
				21.362	Sandvik	408.275	2,00
				88.460	SSAB	493.659	2,42
		3.369.070	16,49			1.572.291	7,70
Canada				Suisse			
53.481	Bravo Mining	177.893	0,87	8.782	Holcim	582.080	2,85
21.370	Cameco	795.180	3,89	2.137	Sika	607.316	2,97
14.593	Filo	228.249	1,12			1.189.396	5,82
13.730	First Quantum Minerals	362.823	1,78	États-Unis			
81.992	Foran Mining	230.911	1,13	3.204	Albemarle	637.115	3,12
61.060	Lundin Mining	469.846	2,30	5.926	Alcoa	178.669	0,87
11.002	Sigma Lithium	330.176	1,62	2.519	Caterpillar	712.222	3,49
12.086	Teck Resources	505.646	2,48	6.269	CF Industries	482.023	2,36
		3.100.724	15,19	3.993	Eastman Chemical	341.322	1,67
Chili				15.729	Fluor	556.020	2,72
2.097	Sociedad Quimica y Minera de Chile	130.475	0,64	13.363	Freeport-McMoRan	538.529	2,64
Finlande				1.012	Martin Marietta Materials	451.281	2,21
35.143	Metso	410.260	2,01	3.320	Nucor	569.214	2,79
France				1.591	Rogers	229.184	1,12
4.362	Air Liquide	796.674	3,90	3.586	Steel Dynamics	382.088	1,87
6.393	Carbios SACA	174.095	0,85			5.077.667	24,86
		970.769	4,75	Total des actions ordinaires			
Allemagne						19.816.816	97,03
6.661	Aurubis	552.274	2,70	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Irlande						19.816.816	97,03
11.351	CRH	655.999	3,21	Total du portefeuille			
1.672	Linde	650.692	3,19	Autres éléments de l'actif net			
		1.306.691	6,40	Total de l'actif net (USD)			
Italie						20.423.202	100,00
8.160	Danieli & C Officine Meccaniche	197.868	0,97				

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Brown To Green Materials Fund⁽²⁾ suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Matériaux de base	66,14
Valeurs industrielles	28,41
Énergie	2,48
Autres éléments de l'actif net	2,97
	100,00

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 12.399.000	Huarong Finance II 5% 19/11/2025	78.029.133	0,30
COMPARTIMENTS				USD 10.000.000	Huarong Finance II 5,5% 16/1/2025	66.583.294	0,25
Singapour				HKD 5.000.000	Link CB 1,6% 3/4/2024	4.504.785	0,02
25.600.000	iShares USD Asia High Yield Bond Index ETF~	1.106.319.131	4,21	USD 600.000	Oriental Capital 7% 28/9/2025	4.135.776	0,02
Total des Compartiments				USD 5.150.000	Peak RE Bvi 5,35% 28/10/2025	31.390.369	0,12
OBLIGATIONS				USD 13.000.000	Qinglun International Bvi 5,45% 16/9/2025*	92.630.796	0,35
Bermudes				USD 5.000.000	SDG Finance 2,4% 25/8/2024*	34.890.588	0,13
USD 19.395.000	China Oil & Gas 4,7% 30/6/2026*	118.182.872	0,45	USD 11.800.000	SDG Finance 4,95% 24/5/2025	83.847.955	0,32
USD 2.546.000	Luye Pharma 6,25% 6/7/2028	16.639.954	0,06	USD 6.000.000	Shuifa International BVI 4% 24/3/2024	41.488.277	0,16
				USD 5.000.000	Sinochem Offshore Capital 2,25% 24/11/2026	32.607.582	0,12
				USD 5.000.000	Sinochem Offshore Capital 2,375% 23/9/2031*	28.562.486	0,11
				USD 2.283.000	Sinopec Overseas Development 2015 4,1% 28/4/2045	13.898.522	0,05
Îles Vierges britanniques				USD 8.000.000	Sinopec Overseas Development 2018 3,35% 13/5/2050*	41.488.132	0,16
USD 7.000.000	Beijing Environment Bvi 1,65% 24/9/2024	48.349.261	0,18	USD 25.000.000	SND International Bvi 2,7% 14/12/2023	179.966.745	0,69
USD 35.000.000	CCCI Treasure 3,425% 21/2/2024	245.246.297	0,93	USD 2.500.000	Studio City 7% 15/2/2027	17.267.229	0,07
USD 16.800.000	Celestial Miles 5,75% 31/1/2024	114.881.970	0,44	USD 3.956.000	Studio City Finance 5% 15/1/2029*	21.653.749	0,08
USD 6.125.000	Central Plaza Development 3,85% 14/7/2025	34.237.739	0,13	USD 9.500.000	Studio City Finance 6% 15/7/2025	65.113.000	0,25
USD 10.000.000	Central Plaza Development 4,65% 19/1/2026	54.157.357	0,21	USD 2.500.000	Studio City Finance 6,5% 15/1/2028	15.240.680	0,06
USD 6.100.000	Central Plaza Development 5,75% 14/11/2024	34.167.003	0,13	USD 10.000.000	Towngas Finance 4,75% 12/2/2024	71.792.446	0,27
USD 5.300.000	Chang Development International 4,3% 27/4/2024	37.295.583	0,14	USD 11.100.000	Vertex Capital Investment 2,85% 28/7/2026*	69.230.046	0,27
USD 1.000.000	Chang Development International 4,3% 9/9/2024	6.881.210	0,03	USD 13.000.000	Vertex Capital Investment 4,75% 3/4/2024	93.055.899	0,36
USD 2.195.000	China Great Wall International III 3,875% 31/8/2027*	13.399.762	0,05	USD 10.000.000	Xiangyu Investment BVI 5% 28/4/2025	72.720.054	0,28
USD 8.489.000	China Great Wall International V 2,875% 23/11/2026*	51.853.467	0,20	USD 18.100.000	Zhongyuan Sincere Investment 4,25% 28/6/2024	129.538.741	0,49
USD 15.085.000	China Great Wall International VI 4,25% 28/4/2025	101.176.216	0,39	USD 5.000.000	Zhuji Development 3,2% 18/10/2024	34.459.341	0,13
USD 12.354.000	CLP Power HK Finance 3,55% 6/2/2025	86.132.165	0,33	Îles Caïmans			
USD 5.000.000	CMHI Finance BVI 3,5% 9/10/2023	36.247.987	0,14	USD 6.950.000	AAC Technologies 2,625% 2/6/2026*	42.220.687	0,16
USD 12.345.000	Coastal Emerald 4,3% 1/8/2024*	87.607.935	0,33	USD 4.000.000	AAC Technologies 3% 27/11/2024*	27.247.794	0,10
USD 3.360.000	Estate Sky 5,45% 21/7/2025	21.631.665	0,08	USD 10.500.000	AAC Technologies 3,75% 2/6/2031	50.917.024	0,19
HKD 56.000.000	Farsail Goldman International 7% 24/11/2026	14.285.445	0,05	USD 4.500.000	Agile 5,5% 21/4/2025	4.092.386	0,02
USD 8.500.000	Fortune Star BVI 5,05% 27/1/2027	39.581.626	0,15	USD 1.250.000	Agile 5,75% 2/1/2025	1.347.213	0,00
USD 4.612.000	Franshion Brilliant 6% 8/2/2026*	29.404.478	0,11	USD 4.500.000	Agile 6,05% 13/10/2025	3.764.995	0,01
USD 1.000.000	Hangzhou Bay Overseas Development 1,95% 24/12/2024	6.871.679	0,03	USD 19.000.000	Alibaba 2,7% 9/2/2041*	88.531.522	0,34
USD 5.000.000	Huafa 2021 I 2,95% 28/2/2025	34.012.453	0,13	USD 13.500.000	Alibaba 3,15% 9/2/2051*	59.428.804	0,23
USD 18.000.000	Huafa 2021 I 4,25% 18/7/2024	125.011.574	0,48	USD 12.000.000	Alibaba 4% 6/12/2037	70.881.863	0,27
USD 10.000.000	Huantaihu International Investment 7,3% 16/2/2026	72.389.753	0,28	USD 10.000.000	CDBL Funding 1 3,5% 24/10/2027	68.200.605	0,26
USD 16.343.000	Huarong Finance 2017 4,25% 7/11/2027	89.895.160	0,34	USD 8.900.000	CDBL Funding 1 4,25% 2/12/2024*	63.413.532	0,24
USD 8.450.000	Huarong Finance 2017 4,75% 27/4/2027	48.326.546	0,18	USD 6.194.000	CDBL Funding 2 1,375% 4/3/2024	44.037.885	0,17
USD 6.000.000	Huarong Finance 2019 6,895% 24/2/2025	39.704.215	0,15	USD 783.000	CDBL Funding 2 2% 4/3/2026	5.239.135	0,02
USD 9.601.000	Huarong Finance II 4,625% 3/6/2026	58.028.082	0,22	USD 1.740.000	China Aoyuan 5,375% 13/9/2022***	379.773	0,00

~ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net
CNY 30.000.000	Beijing Capital Development 5% 21/2/2028	30.986.520	0,12	CNY 70.000.000	China Development Bank 2,68% 13/9/2029	70.141.190	0,27
CNY 15.000.000	Beijing Easyhome Investment 6,3% 5/9/2023	14.989.890	0,06	CNY 300.000.000	China Development Bank 2,69% 16/6/2027	302.646.573	1,15
CNY 50.000.000	Beijing Electronic Zone High-tech 3,55% 25/5/2025	50.159.452	0,19	CNY 25.000.000	China Development Bank 2,96% 18/7/2032	25.349.538	0,10
CNY 10.000.000	Beijing Electronic Zone High-tech 3,66% 20/6/2025	10.050.587	0,04	CNY 70.000.000	China Development Bank 3,07% 10/3/2030	71.700.154	0,27
CNY 4.578.400	Beijing Strong Biotechnologies 0,5% 30/6/2028	6.001.619	0,02	CNY 150.000.000	China Development Bank 3,12% 13/9/2031	153.888.579	0,58
CNY 60.000.000	Beijing Tianheng Development 4,34% 9/3/2028	61.170.600	0,23	CNY 200.000.000	China Development Bank 3,41% 7/6/2031	209.102.908	0,80
CNY 8.503.000	Beijing Trust&Far Technology 1,5% 15/7/2026	11.511.319	0,04	CNY 90.000.000	China Development Bank 3,43% 14/1/2027	92.802.609	0,35
CNY 20.998.700	Bengang Steel Plates 2,9% 29/6/2026	25.482.342	0,10	CNY 175.000.000	China Development Bank 3,45% 20/9/2029	182.990.237	0,70
CNY 20.000.000	Brilliance Auto 5,8% 20/3/2024***	7.446.000	0,03	CNY 150.000.000	China Development Bank 3,49% 8/11/2041	162.031.551	0,62
CNY 10.000.000	C&D Real Estate 3,88% 22/5/2025	10.117.920	0,04	CNY 70.000.000	China Development Bank 3,65% 21/5/2029	73.838.450	0,28
CNY 30.000.000	C&D Real Estate 4,3% 30/7/2025	30.526.200	0,12	CNY 200.000.000	China Development Bank 4,88% 9/2/2028	219.637.726	0,84
CNY 20.000.000	C&D Real Estate 4,46% 21/10/2025	20.463.275	0,08	CNY 9.000.000	China Galaxy 0,4% 24/3/2028	11.745.855	0,04
CNY 30.000.000	CCCG Real Estate 4,07% 27/3/2025	29.953.500	0,11	CNY 140.000.000	China Government Bond 2,6% 1/9/2032	139.654.263	0,53
CNY 30.000.000	CCCG Real Estate 4,09% 18/4/2025	29.909.100	0,11	CNY 300.000.000	China Government Bond 2,8% 15/11/2032	303.868.929	1,16
CNY 100.000.000	Central Huijin Investment 3,71% 18/9/2027	104.253.000	0,40	CNY 200.000.000	China Government Bond 3,12% 25/10/2052	207.493.386	0,79
CNY 30.000.000	Changchun Urban Development & Investment 3,8% 30/4/2025	29.254.529	0,11	CNY 260.000.000	China Government Bond 3,19% 15/4/2053	275.414.074	1,05
CNY 20.000.000	Changchun Urban Development & Investment 4,3% 26/10/2023	20.036.590	0,08	CNY 95.000.000	China Government Bond 3,32% 15/4/2052	102.138.348	0,39
CNY 20.000.000	Changchun Urban Development & Investment 5% 1/9/2024	20.206.600	0,08	CNY 40.000.000	China Huadian 3,25% 21/6/2026	40.308.240	0,15
USD 9.500.000	Changde Urban Construction and Investment 3% 4/11/2023	68.434.016	0,26	CNY 80.000.000	China Huadian 3,5% 16/4/2025	81.115.794	0,31
CNY 14.000.000	Changjiang & Jinggong Steel Building 0,5% 22/4/2028	16.115.400	0,06	CNY 70.000.000	China Huadian 3,68% 14/2/2025	71.054.803	0,27
CNY 40.000.000	Chengdu Hi-tech Investment 3,65% 26/4/2024	40.539.980	0,16	CNY 20.000.000	China Huadian 3,84% 13/1/2026	20.442.110	0,08
CNY 40.000.000	Chengdu Hi-tech Investment 3,9% 21/11/2025	40.784.080	0,16	CNY 40.000.000	China International Capital 4,2% 26/4/2026	41.253.220	0,16
CNY 10.000.000	Chengdu Rail Transit 4,16% 16/6/2025	10.240.520	0,04	CNY 70.000.000	China International Capital 4,68% 29/1/2026	72.845.990	0,28
CNY 80.000.000	Chengdu Rail Transit 4,23% 23/3/2024	80.750.600	0,31	CNY 80.000.000	China Merchants 2,7% 24/10/2025	79.700.800	0,30
USD 9.400.000	Chengdu Tianfu New Area Investment 4,65% 7/5/2024	67.552.262	0,26	CNY 60.000.000	China Merchants 2,8% 28/9/2025	60.087.420	0,23
EUR 1.000.000	Chengdu Xiangcheng Investment 3,8% 23/10/2023	7.900.581	0,03	CNY 21.918.000	China Merchants Expressway Network & Technology 1,5% 22/3/2025	28.053.944	0,11
CNY 450.000.000	China Construction Bank 3,45% 10/8/2031	457.932.600	1,74	CNY 10.000.000	China National Building Material 3,65% 2/3/2025	10.138.525	0,04
CNY 60.000.000	China Construction Bank 4,2% 14/9/2030	61.828.590	0,24	CNY 180.000.000	China National Petroleum 2,99% 23/3/2025	181.363.961	0,69
CNY 60.000.000	China Datang 2,66% 3/11/2025	59.662.080	0,23	CNY 60.000.000	China National Petroleum 2,99% 23/3/2025	60.340.335	0,23
CNY 30.000.000	China Datang 2,79% 15/8/2025	30.028.500	0,11	CNY 20.000.000	China Orient Asset Management 3,15% 15/3/2025	20.115.260	0,08
CNY 70.000.000	China Datang 3,1% 26/7/2026	70.257.390	0,27	CNY 100.000.000	China Resources Land 2,84% 15/11/2027	99.557.050	0,38
CNY 30.000.000	China Datang 3,32% 29/11/2024	30.279.300	0,12	CNY 49.816.000	China Southern Airlines 0,6% 15/10/2026	64.726.178	0,25
CNY 50.000.000	China Datang 3,79% 28/12/2024	50.758.975	0,19	CNY 40.000.000	China Southern Power Grid 2,7% 27/5/2025	40.177.526	0,15
				CNY 20.000.000	China Suntien Green Energy 3,86% 15/5/2025	20.407.956	0,08

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

China Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net
CNY 35.741.000	China Three Gorges 0,1% 1/6/2027	40.030.456	0,15	USD 8.000.000	Gansu Provincial Highway Aviation Tourism Investment 3,25% 3/11/2023*	57.560.257	0,22
CNY 17.860.000	China Three Gorges 0,5% 9/4/2024	26.388.150	0,10	USD 1.300.000	Gansu Provincial Highway Aviation Tourism Investment 3,5% 10/6/2024	8.946.566	0,03
CNY 14.000.000	Chongqing Construction Engineering 2% 20/12/2025	16.047.500	0,06	USD 2.000.000	Gansu Provincial Highway Aviation Tourism Investment 4,9% 30/3/2025	13.287.485	0,05
CNY 40.000.000	Chongqing Fuling State-owned Asset Investment Operation 4,72% 19/11/2023	40.168.220	0,15	USD 13.395.000	Ganzhou Urban Investment 3% 12/10/2024	93.017.752	0,35
CNY 1.500.000	Chongqing Longhu Development 3,35% 11/8/2026	1.388.114	0,01	CNY 10.000.000	Gemdale 3,93% 12/11/2023	9.068.677	0,03
CNY 5.500.000	Chongqing Longhu Development 3,48% 17/2/2024	5.284.342	0,02	CNY 5.000.000	Gemdale 3,95% 12/10/2025	4.828.292	0,02
CNY 6.000.000	Chongqing Longhu Development 3,49% 14/1/2028	5.320.860	0,02	CNY 9.707.000	Guangdong Great River Smarter Logistics 1,5% 17/7/2026	12.763.540	0,05
CNY 100.000	Chongqing Longhu Development 3,5% 21/2/2024	96.057	0,00	CNY 40.000.000	Guangxi Communications Investment 3,46% 10/4/2025	40.343.547	0,15
CNY 20.000.000	Chongqing Longhu Development 3,5% 21/5/2026	18.866.200	0,07	USD 15.470.000	Guangxi Financial Investment 3,6% 18/11/2023	111.211.480	0,42
CNY 20.000.000	Chongqing Longhu Development 3,7% 9/12/2036	18.463.690	0,07	CNY 14.000.000	Guangzhou Holike Creative Home 1,8% 1/8/2025	16.073.330	0,06
CNY 27.700.000	Chongqing Longhu Development 3,8% 4/3/2027	22.175.138	0,08	CNY 130.000.000	Guangzhou Metro 3,07% 26/1/2025	126.797.710	0,48
CNY 30.200.000	Chongqing Longhu Development 4,2% 17/1/2027	24.471.498	0,09	CNY 22.187.700	Guangzhou Tinci Materials Technology 0,3% 23/9/2027	25.725.973	0,10
CNY 800.000	Chongqing Longhu Development 4,44% 25/1/2024	774.000	0,00	CNY 35.000.000	Guiyang City Construction Investment 4,37% 25/3/2026	15.135.260	0,06
CNY 16.600.000	Chongqing Longhu Development 4,67% 19/7/2026	14.795.406	0,06	CNY 10.000.000	Guizhou Water Investment 4% 20/3/2025	10.079.622	0,04
USD 8.185.000	Chongqing Nan'an Urban Construction & Development 4,5% 17/8/2026	52.716.533	0,20	USD 20.610.000	Guoren Property & Casualty Insurance 3,35% 1/6/2026	129.157.380	0,49
CNY 10.000.000	Cinda Real Estate 4,5% 21/7/2028	10.034.537	0,04	CNY 22.000.000	Hainan Jinpan Smart Technology 0,3% 16/9/2028	29.248.450	0,11
CNY 60.000.000	Cinda Real Estate 5,15% 25/3/2026	61.126.230	0,23	CNY 20.000.000	Hangzhou Binjiang Real Estate 4,56% 24/2/2024	20.092.780	0,08
CNY 3.000.000	Country Garden 5,65% 2/9/2023	833.475	0,00	CNY 70.000.000	Hangzhou Binjiang Real Estate 4,8% 10/3/2024	70.467.600	0,27
CNY 8.600.000	Dalian Wanda Commercial Management 5,58% 9/9/2025	8.213.000	0,03	CNY 60.000.000	Hangzhou Binjiang Real Estate 5,8% 23/11/2024	60.461.550	0,23
CNY 10.000.000	Datang International Power Generation 2,75% 17/8/2025	9.999.930	0,04	CNY 40.000.000	Hangzhou Municipal Construction Investment 3,87% 1/2/2026	41.061.344	0,16
CNY 60.000.000	Datang International Power Generation 3,99% 16/1/2026	61.602.540	0,23	CNY 13.130.100	Hangzhou Shenhao Technology 0,5% 18/3/2028	15.616.613	0,06
CNY 150.000.000	DBS Bank China 4,7% 24/3/2031	154.775.625	0,59	CNY 120.000.000	Harbin City Construction Investment 4,74% 19/10/2025	120.407.340	0,46
CNY 6.434.000	Dynagreen Environmental Protection 0,4% 25/2/2028	7.101.721	0,03	CNY 30.000.000	HBIS 4,44% 9/7/2025	30.736.485	0,12
CNY 35.000.000	Excellence Commercial Properties 6,66% 30/3/2024	34.846.035	0,13	CNY 100.000.000	Hefei Industry Investment 3,5% 29/4/2025	101.447.248	0,38
CNY 45.297.000	Flat Glass 0,5% 20/5/2028	52.825.814	0,20	CNY 10.000.000	Hefei Industry Investment 4,43% 20/8/2024	10.190.806	0,04
USD 1.000.000	Fujian Zhanglong 3,45% 19/12/2023	7.210.383	0,03	CNY 1.000.000	Henan Mingtai AI Industrial 2% 10/4/2025	1.940.955	0,01
CNY 30.000.000	Futong 7% 26/4/2024	29.932.905	0,11	CNY 70.000.000	Huadian Power International 3,68% 20/2/2025	71.058.331	0,27
USD 5.000.000	Gansu Province Electric Power Investment 3,7% 29/9/2024	33.925.876	0,13	CNY 90.000.000	Huaneng Power International 2,66% 3/11/2025	89.760.195	0,34
				CNY 230.000.000	Hubei Provincial Communications Investment 3,93% 9/3/2025	233.679.144	0,89
				CNY 20.000.000	Hubei Provincial Communications Investment 4,47% 3/12/2024	20.410.530	0,08
				CNY 130.000.000	Hubei Science & Technology Investment 4,7% 17/3/2031	135.565.499	0,52
				CNY 40.000.000	Huzhou Communications Investment 4,19% 19/4/2036	41.404.680	0,16

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

China Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net
CNY 10.000.000	Huzhou Moganshan Hi-tech 4,75% 28/4/2026	10.156.195	0,04	CNY 80.000.000	Ping An International Financial Leasing 3,8% 25/4/2025	80.919.040	0,31
CNY 270.000.000	Industrial & Commercial Bank of China 4,15% 16/11/2030	277.756.930	1,06	CNY 80.000.000	Ping An Life Insurance of China 3,58% 1/4/2030	81.014.453	0,31
CNY 160.000.000	Industrial & Commercial Bank of China 4,2% 24/9/2030	164.772.234	0,63	CNY 50.000.000	Ping An Real Estate 3,85% 22/10/2023	49.619.200	0,19
CNY 104.000.000	Industrial Bank 0,4% 27/12/2027	107.452.280	0,41	CNY 20.000.000	Pinghu State-owned Asset 3,5% 4/9/2023	20.001.690	0,08
CNY 60.000.000	Inner Mongolia Transportation 4,77% 8/11/2024	61.408.579	0,23	CNY 240.000.000	Postal Savings Bank of China 3,44% 23/8/2031	243.627.206	0,93
CNY 10.000.000	Inner Mongolia Transportation 5,34% 5/6/2024	10.209.760	0,04	CNY 30.000.000	Postal Savings Bank of China 3,54% 8/3/2032	30.528.195	0,12
CNY 40.000.000	Jiangmen City Transportation Construction Investment 4,47% 19/5/2025	40.283.407	0,15	CNY 30.000.000	Powerchina Real Estate 4,18% 26/4/2026	30.315.915	0,12
CNY 8.000.000	Jiangsu Dingsheng New Energy Materials 1,8% 9/4/2025	16.376.960	0,06	USD 800.000	Rudong County Jinxin Transportation Engineering Construction Investment 2,68% 22/10/2024	5.554.091	0,02
CNY 25.000.000	Jiangsu Eastern Shenghong 0,6% 22/3/2027	31.338.375	0,12	CNY 100.000.000	Shaanxi Transportation 3,33% 13/10/2026	100.038.625	0,38
CNY 16.980.100	Jiangxi Wannianqing Cement 1,5% 3/6/2026	19.380.492	0,07	CNY 60.000.000	Shaanxi Yanchang Petroleum 4,25% 13/11/2023	60.223.320	0,23
USD 2.000.000	Jiaxing City Investment & Development 2,6% 29/10/2023	14.437.136	0,06	CNY 60.000.000	Shaanxi Yanchang Petroleum 4,63% 8/12/2023	60.340.290	0,23
CNY 50.000.000	Jilin Provincial Expressway 4,09% 8/5/2030	50.934.871	0,19	CNY 20.000.000	Shanghai Fosun High Technology 4,8% 22/9/2025	19.983.350	0,07
CNY 10.000.000	Jilin Provincial Expressway 4,1% 23/4/2030	10.218.260	0,04	CNY 20.000.000	Shanghai Fosun High Technology 4,8% 2/11/2025	20.000.670	0,08
USD 6.930.000	Jinan Hi-tech 2,8% 22/11/2024	48.072.231	0,18	CNY 50.000.000	Shanghai Fosun Pharmaceutical 3,5% 9/3/2026	49.865.050	0,19
CNY 30.000.000	Jingrui Real Estate 7% 7/8/2024	30.053.851	0,11	CNY 22.169.000	Shanghai Powerlong Industrial Development 6,5% 7/8/2023***	9.393.892	0,04
CNY 11.000.000	Jining city Shizhong District Urban Construction Investment 3,52% 14/9/2023	2.198.927	0,01	CNY 20.000.000	Shanghai Powerlong Industrial Development 6,5% 27/8/2023***	8.105.000	0,03
USD 7.000.000	Jinjiang Road & Bridge Construction Development 6,08% 18/6/2024	50.872.344	0,19	CNY 4.992.000	Shanghai Powerlong Industrial Development 6,6% 11/1/2024	2.741.272	0,01
CNY 11.542.000	Jinke Properties 5% 28/5/2024	2.770.080	0,01	CNY 85.068.000	Shanghai Pudong Development Bank 2,1% 28/10/2025	94.074.149	0,36
CNY 6.091.000	Jinko Solar 0,2% 20/4/2029	7.052.708	0,03	CNY 70.000.000	Shanghai Pudong Development Bank 4,27% 17/9/2030	71.946.734	0,27
CNY 30.000.000	Kaisa Group Shenzhen 7% 25/6/2023***	14.194.830	0,06	CNY 42.600.000	Shanghai Shimao Jianshe 3,2% 11/5/2025	9.052.500	0,03
USD 5.030.000	Kunming Rail Transit 3,9% 12/12/2024	31.125.346	0,12	CNY 16.900.000	Shanghai Shimao Jianshe 3,23% 25/3/2025	3.601.136	0,01
USD 5.100.000	Kunming Rail Transit 8,5% 7/12/2025	30.592.147	0,12	CNY 119.699.000	Shanghai Shimao Jianshe 4,3% 11/11/2024	25.508.814	0,10
CNY 19.000.000	Kunming Traffic Investment 5% 9/6/2024	18.745.732	0,07	CNY 25.000.000	Shanghai Shimao Jianshe 4,8% 11/11/2026	5.327.250	0,02
CNY 29.556.000	Legend 5,3% 15/1/2024	29.331.611	0,11	CNY 20.000.000	Shanghai Yuyuan Tourist Mart 4,2% 9/9/2023	20.004.000	0,08
CNY 8.300.000	Legend 5,5% 21/6/2024	8.179.725	0,03	CNY 20.000.000	Shanghai Yuyuan Tourist Mart 4,7% 15/10/2024	20.001.475	0,08
CNY 63.500.000	LONGi Green Energy Technology 0,4% 5/1/2028	67.916.425	0,26	CNY 90.000.000	Shangrao Binjiang Investment 7% 2/7/2024	91.217.025	0,35
CNY 30.000.000	Midea Properties 4,6% 2/2/2026	30.027.045	0,11	CNY 110.000.000	Shangrao Investment 4,2% 31/7/2025	111.515.745	0,42
CNY 26.999.000	Muyuan Foods 0,8% 16/8/2027	32.032.559	0,12	CNY 30.000.000	Shanxi Construction Investment 4,94% 22/6/2024	30.272.310	0,11
USD 5.000.000	Nanchang Jinkai 3,45% 29/6/2024	36.012.993	0,14	CNY 50.000.000	Shanxi Road & Bridge Construction 4,85% 14/4/2025	50.472.800	0,19
CNY 16.000.000	Ningbo Tuopu 0,4% 14/7/2028	21.235.200	0,08	CNY 19.999.300	Shenzhen Farben Information Technology 0,4% 21/10/2028	28.581.099	0,11
CNY 14.796.000	Oppein Home 0,5% 5/8/2028	17.832.583	0,07				
CNH 36.000.000	Pharmaron Beijing 0% 18/6/2026	35.423.640	0,14				
USD 4.800.000	Pharmaron Beijing 0% 18/6/2026	32.258.911	0,12				
CNY 80.000.000	PICC Property & Casualty 3,59% 23/3/2030	81.168.960	0,31				
CNY 16.404.000	Piesat Information Technology 0,4% 28/11/2028	21.316.506	0,08				

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

China Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net
CNY 7.071.000	Shenzhen Gas 0,2% 27/7/2029	8.726.286	0,03	USD 250.000	Weifang Urban Construction & Development Investment 2,6% 27/9/2024	1.669.502	0,01
CNY 10.000.000	Shudao Investments 2,99% 31/10/2025	9.995.000	0,04	CNY 17.000.000	Wens Foodstuffs 1% 29/3/2027	21.061.980	0,08
CNY 10.000.000	Shudao Investments 3,01% 7/11/2025	10.018.815	0,04	CNY 5.100.000	Wuhan Jingce Electronic 0,2% 2/3/2029	8.423.900	0,03
CNY 40.000.000	Shudao Investments 3,5% 16/11/2025	40.251.080	0,15	CNY 150.000.000	Wuhan Metro 2,91% 27/9/2025	150.395.925	0,57
CNY 8.500.000	Sichuan Chuantou Energy 1,5% 11/11/2025	15.420.445	0,06	CNY 230.000.000	Wuhan Metro 4,4% 24/3/2026	241.417.660	0,92
CNY 40.000.000	Sichuan Energy Industry Investment 4,68% 23/3/2024	40.452.280	0,15	CNY 95.000.000	Xiamen Yuzhou Grand Future Real Estate Development 6,5% 24/7/2025	29.122.250	0,11
CNY 13.200.000	Sino-Ocean Capital 5,3% 9/9/2023	6.667.650	0,03	CNY 65.000.000	Xiamen Yuzhou Grand Future Real Estate Development 6,5% 15/9/2025	19.922.500	0,08
CNY 40.000.000	State Power Investment 2,71% 28/10/2025	39.945.260	0,15	CNY 30.000.000	Xi'an Hi-tech 3,99% 25/3/2025	30.247.800	0,11
CNY 20.000.000	State Power Investment 2,71% 31/10/2025	19.972.130	0,08	CNY 10.000.000	Xi'an Hi-tech 3,99% 20/4/2025	10.094.845	0,04
CNY 40.000.000	State Power Investment 2,73% 18/8/2025	39.991.800	0,15	CNY 22.325.000	Xi'an Triangle Defense 1% 25/5/2027	29.807.000	0,11
CNY 90.000.000	State Power Investment 2,8% 29/8/2025	90.050.400	0,34	CNY 20.000.000	Xiangtan High-Tech Infrastructure Construction 7,95% 29/12/2026	20.138.790	0,08
CNY 30.000.000	State Power Investment 3,17% 5/6/2026	30.178.260	0,12	CNY 10.000.000	Xinxiang Investment 3,7% 11/3/2025	10.102.647	0,04
CNY 50.000.000	State Power Investment 3,57% 11/5/2025	50.692.258	0,19	CNY 30.000.000	Xinxing Cathay International 3,8% 22/4/2025	30.473.280	0,12
CNY 10.000.000	State Power Investment 4,07% 16/8/2024	10.146.755	0,04	USD 1.000.000	Xuchang General Investment 5% 7/7/2024	7.057.091	0,03
CNY 10.000.000	State Power Investment 4,2% 22/10/2024	10.183.270	0,04	CNY 20.000.000	Yiwu State-owned Capital Operation 3,78% 3/4/2025	20.356.305	0,08
CNY 58.310.000	Sunac Real Estate 7% 9/12/2025	8.232.643	0,03	CNY 10.000.000	Yiyang City Transportation Investment Development 5,58% 14/9/2025	10.056.900	0,04
USD 17.790.000	Sunshine Life Insurance 4,5% 20/4/2026*	115.289.095	0,44	CNY 20.000.000	Yiyang Province Area Innovative Plant Construction Collecting Bond 4,95% 13/10/2023	4.000.840	0,01
CNY 9.490.400	Suzhou Huaya Intelligence Technology 0,4% 16/12/2028	12.252.059	0,05	CNY 110.000.000	Yiyang Province Area Innovative Plant Construction Collecting Bond 5,16% 23/11/2023	22.113.300	0,08
CNY 20.000.000	Suzhou Rail Transit 3,82% 18/8/2025	20.494.849	0,08	CNY 8.000.000	Yunnan Energy New Material 1,5% 11/2/2026	10.625.040	0,04
CNY 30.000.000	Tianjin Binhai New Area Construction & Investment 5,8% 29/9/2023	30.052.275	0,11	CNY 21.097.000	Zhangjiagang Guangda Special Material 0,3% 13/10/2028	23.472.628	0,09
CNY 10.000.000	Tianjin Free Trade Zone Investment 5,5% 21/1/2024	10.050.170	0,04	CNY 30.000.000	Zhangzhou Yuanshan Development 5,78% 23/6/2024	30.518.850	0,12
CNY 10.000.000	Tianjin Infrastructure Construction & Investment 4,3% 16/1/2024	10.057.400	0,04	CNY 12.628.000	Zhejiang Huahai Pharmaceutical 1% 2/11/2026	14.088.933	0,05
CNY 10.000.000	Tianjin Infrastructure Construction & Investment 7,6% 19/4/2024	10.268.905	0,04	CNY 50.000.000	Zhejiang Huayou Cobalt 0,4% 24/2/2028	54.646.250	0,21
CNY 10.000.000	Tianjin Infrastructure Construction & Investment 7,6% 20/4/2024	10.270.105	0,04	CNY 70.000.000	Zhejiang Huzhou Huantaihu 4,7% 2/9/2025	70.815.710	0,27
CNY 10.000.000	Tianjin Infrastructure Construction & Investment 7,7% 21/3/2024	10.251.045	0,04	CNY 50.000.000	Zhejiang Huzhou Huantaihu 5,08% 22/1/2026	50.509.550	0,19
USD 9.000.000	Tianjin Rail Transit Urban Development 6,2% 25/9/2023	65.314.473	0,25	CNY 9.527.000	Zhejiang Wazam New Materials 0,4% 24/1/2028	11.685.199	0,04
CNY 30.000.000	TongLing Comprehensive Traffic Investment 5,36% 18/1/2026	30.316.020	0,11	USD 11.300.000	Zhengzhou Urban Construction Investment 3,8% 16/1/2025	78.796.824	0,30
CNY 18.905.000	Tongwei 0,4% 24/2/2028	22.741.770	0,09	USD 24.262.000	ZhongAn Online P&C Insurance 3,125% 16/7/2025	154.940.978	0,59
CNY 12.306.700	Unigroup Guoxin Microelectronics 0,6% 10/6/2027	16.909.098	0,07	USD 5.920.000	ZhongAn Online P&C Insurance 3,5% 8/3/2026*	36.700.234	0,14
CNY 25.000.000	Universal Scientific Industrial Shanghai 0,6% 4/3/2027	29.343.750	0,11	CNY 20.000.000	Zhuhai Huafa 5,3% 11/12/2024	20.458.330	0,08
				USD 10.000.000	Zhuzhou City Construction Development 4,6% 29/3/2025	69.206.786	0,26
				CNY 7.923.000	Zhuzhou Kibing 0,6% 9/4/2027	9.802.692	0,04

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

China Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net
CNY 40.000.000	Zhuzhou State-owned Asset Investment 4,3% 3/7/2025	40.379.680	0,15	USD 276.360	JSW Hydro Energy 4,125% 18/5/2031	1.697.000	0,01
CNY 20.000.000	Zhuzhou State-owned Asset Investment 4,7% 18/8/2025	20.188.150	0,08	USD 3.950.000	JSW Infrastructure 4,95% 21/1/2029*	25.218.717	0,10
		14.898.410.144	56,76	USD 1.521.000	Muthoot Finance 4,4% 2/9/2023	11.064.704	0,04
				USD 9.096.000	REC 5,25% 13/11/2023*	66.092.227	0,25
				USD 2.750.000	Shriram Finance 4,4% 13/3/2024	19.692.605	0,08
						190.420.378	0,73
	Hong Kong				Japon		
USD 6.450.000	China Taiping Insurance 6,4% 9/3/2028	47.978.337	0,18	USD 5.830.000	Asahi Mutual Life Insurance 6,9% 26/1/2028*	42.989.874	0,16
USD 4.000.000	Chong Hing Bank 5,5% 3/8/2025	27.469.110	0,10	USD 17.000.000	Mizuho Financial 3,922% 11/9/2024	123.621.148	0,47
USD 4.000.000	CNAC HK Finbridge 3,35% 22/9/2023	29.026.326	0,11			166.611.022	0,63
USD 5.000.000	Far East Horizon 2,625% 3/3/2024	34.166.144	0,13		Koweït		
USD 9.000.000	Far East Horizon 4,25% 26/10/2026*	52.973.148	0,20	USD 7.378.000	Burgan Bank SAK 2,75% 15/12/2031	40.898.802	0,16
CNY 34.893.000	GLP China 4,4% 2/5/2027	29.663.115	0,11		Luxembourg		
USD 15.000.000	Guoneng Environmental Protection Investment 6% 17/4/2024	108.791.977	0,41	USD 7.000.000	Greensaif Pipelines Bidco 6,129% 23/2/2038	51.187.194	0,20
USD 5.100.000	Huatong International Investment 2,98% 4/3/2024	36.249.412	0,14		Maurice		
USD 7.412.000	Huaxin Cement International Finance 2,25% 19/11/2025	48.511.927	0,18	USD 4.000.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	26.140.049	0,10
USD 14.000.000	Jinan Urban Construction International Investment 2,3% 10/11/2024	96.914.455	0,37	USD 1.250.000	India Airport Infra 6,25% 25/10/2025	8.909.532	0,03
USD 12.600.000	Jinchuan Golden Ocean Capital 4% 10/2/2024	90.523.568	0,35	USD 6.630.000	India Cleantech Energy 4,7% 10/8/2026	42.091.818	0,16
USD 13.560.000	Lai Sun MTN 5% 28/7/2026	56.121.665	0,21	USD 7.100.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024	50.880.174	0,20
USD 6.801.000	Minsheng Hong Kong International Leasing Via Landmark Funding 2020 3,15% 10/3/2024	47.914.875	0,18	USD 3.000.000	India Green Power 4% 22/2/2027	19.334.394	0,07
USD 12.620.000	Pingan Real Estate Capital 2,75% 29/7/2024	73.451.954	0,28	USD 8.000.000	Network i2i 5,65% 15/1/2025	56.655.494	0,21
USD 16.550.000	Pingan Real Estate Capital 3,45% 29/7/2026*	89.101.236	0,34			204.011.461	0,77
USD 19.500.000	SCI HK Development 2,95% 30/3/2024*	138.040.310	0,53		Pays-Bas		
USD 5.000.000	Shanghai Hong Kong International Investments 5% 16/6/2025	33.814.381	0,13	USD 13.062.240	Greenko Dutch 3,85% 29/3/2026*	86.025.224	0,33
CNH 80.000.000	Swire Properties MTN Financing 3,3% 25/7/2025	80.143.544	0,31	USD 7.027.000	Minejesa Capital 4,625% 10/8/2030	46.349.182	0,17
CNH 28.000.000	Vanke Real Estate Hong Kong 3,45% 25/5/2024	25.496.992	0,10			132.374.406	0,50
USD 5.000.000	Vanke Real Estate Hong Kong 3,5% 12/11/2029*	24.424.084	0,09		Philippines		
USD 6.000.000	Vanke Real Estate Hong Kong 3,975% 9/11/2027*	33.469.384	0,13	USD 7.900.000	Rizal Commercial Banking 6,5% 27/8/2025	52.649.656	0,20
USD 10.000.000	Westwood 2,8% 20/1/2026*	65.911.779	0,25		Singapour		
USD 2.000.000	Westwood 3,8% 20/1/2031	11.449.731	0,04	USD 3.683.000	Continuum Energy Aura 9,5% 24/2/2027	26.828.616	0,10
USD 7.500.000	Xiaomi Best Time International 2,875% 14/7/2031	41.463.504	0,16	USD 13.000.000	DBS 3,3% 27/2/2025	89.762.165	0,34
USD 3.110.000	Yango Justice International 7,5% 17/2/2025***	339.395	0,00	USD 3.200.000	Medco Bell 6,375% 30/1/2027	21.650.454	0,08
USD 17.314.000	Yango Justice International 7,875% 4/9/2024	1.889.482	0,01	SGD 7.250.000	Straits Trading 3,25% 13/2/2028	34.338.987	0,13
USD 3.825.000	Yango Justice International 8,25% 25/11/2023***	417.423	0,00	USD 10.345.000	United Overseas Bank 3,875% 19/10/2023	74.954.560	0,29
USD 6.000.000	Yanlord Land HK 5,125% 20/5/2026	24.990.834	0,10			247.534.782	0,94
		1.350.708.092	5,14		Corée du Sud		
				USD 3.000.000	Hana Bank 4,25% 14/10/2024*	21.356.687	0,08
				USD 4.000.000	SK Hynix 2,375% 19/1/2031	22.564.795	0,09
				USD 8.500.000	SK Hynix 6,25% 17/1/2026	62.095.893	0,24
				USD 4.100.000	SK Hynix 6,375% 17/1/2028*	30.185.996	0,11
						136.203.371	0,52
	Inde				Thaïlande		
USD 974.000	Axis Bank 4,1% 8/9/2026	6.180.258	0,02	USD 7.000.000	Bangkok Bank 3,733% 25/9/2034	43.314.318	0,17
USD 5.735.000	GMR Hyderabad International Airport 4,25% 27/10/2027	37.259.452	0,14	USD 1.004.000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025	6.917.317	0,03
USD 3.672.000	HDFC Bank 3,7% 25/8/2026*	23.215.415	0,09				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net
USD 6.000.000	Kasikornbank 3,343% 2/10/2031	39.170.568	0,15	CNY 20.000.000	Zhejiang Huayou Cobalt 4,68% 15/12/2023	20.098.786	0,08
USD 7.000.000	Kasikornbank 5,458% 7/3/2028	50.868.643	0,19	CNY 30.000.000	Zhuzhou Geckor 5,44% 22/1/2024	30.081.900	0,11
USD 8.500.000	Thaioil Treasury Center 2,5% 18/6/2030	49.591.128	0,19	Total des billets de trésorerie		328.985.203	1,25
USD 3.500.000	Thaioil Treasury Center 3,5% 17/10/2049	15.722.454	0,06	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		24.804.194.831	94,47
		205.584.428	0,79	Autres titres négociables			
Royaume-Uni				OBLIGATIONS			
USD 9.100.000	HSBC 5,887% 14/8/2027	65.974.961	0,25	Bermudes			
USD 1.963.000	HSBC 6,332% 9/3/2044	14.428.795	0,06	HKD 1.160.847	REXLot 4,5% 17/4/2019**,**	134.604	0,00
USD 5.350.000	HSBC 6,905% 14/8/2027	39.096.867	0,15	Chine			
USD 7.000.000	Standard Chartered 6,296% 6/7/2034*	50.721.060	0,19	CNY 10.000.000	China Fortune Land Development 7,4% 9/3/2021**,**	3.681.250	0,02
		170.221.683	0,65	CNY 42.000.000	Fantasia China 7,5% 17/12/2023**	18.577.650	0,07
États-Unis				CNY 15.000.000	Ningxia Yuangao Industrial 7,5% 22/11/2020**,**	15.000.000	0,06
USD 4.563.000	Periama 5,95% 19/4/2026	31.662.382	0,12	CNY 45.000.000	Shanghai Powerlong Industrial Development 7,4% 15/7/2023**,**	18.135.023	0,07
USD 3.200.000	Resorts World Las Vegas / RWLV Capital 4,625% 16/4/2029	19.074.227	0,07	CNY 26.897.000	Shanghai Shimao Jianshe 4,15% 16/10/2024**	6.100.481	0,02
		50.736.609	0,19	CNY 11.850.000	Sunac Real Estate 6,48% 9/12/2025**	2.402.730	0,01
Vietnam				CNY 50.000.000	Zhongtian Financial 8,5% 16/8/2022**,**	50.000.000	0,19
USD 2.200.000	BIM Land JSC 7,375% 7/5/2026	11.391.230	0,04			113.897.134	0,44
Total des obligations		23.368.890.497	89,01	Hong Kong			
BILLET DE TRÉSORERIE				CNY 3.736.953	China City Construction International 5,35% 3/7/2017**,**	-	0,00
Chine				Total des obligations			
CNY 10.000.000	Henan Airport Investment 2,85% 28/10/2023	9.990.270	0,04			114.031.738	0,44
CNY 20.000.000	Henan Airport Investment 4,88% 26/12/2023	20.084.200	0,08	BILLET DE TRÉSORERIE			
CNY 40.000.000	Huangshi Cihu High-tech Development 4,5% 20/9/2023	39.980.840	0,15	Chine			
CNY 20.000.000	Huangshi Cihu High-tech Development 6,5% 28/11/2023	20.004.200	0,07	CNY 20.000.000	Tianjin Binhai New Area Construction & Investment 6,9% 18/11/2023**	19.977.340	0,08
CNY 30.000.000	Shanxi Culture Tourism Investment 4,55% 17/3/2024	29.981.490	0,11	CNY 40.000.000	Yunnan Provincial Investment 6,24% 19/12/2023**	40.067.600	0,15
CNY 10.000.000	Tianjin Binhai New Area Construction & Investment 6,95% 19/10/2023	10.045.640	0,04	Total des billets de trésorerie		60.044.940	0,23
CNY 30.000.000	Tianjin Infrastructure Construction & Investment 7,44% 21/4/2024	30.765.900	0,12	Total des autres valeurs mobilières		174.076.678	0,67
CNY 10.000.000	Tianjin TEDA Investment 6,95% 14/10/2023	10.006.440	0,04	Total du portefeuille		24.978.271.509	95,14
CNY 20.000.000	Tianjin TEDA Investment 6,96% 26/10/2023	20.027.180	0,08	Autres éléments de l'actif net		1.275.186.351	4,86
CNY 30.000.000	Tianjin Wuqing State-owned Asset Operation Investment 7% 1/1/2024	30.154.830	0,11	Total de l'actif net (CNH)		26.253.457.860	100,00
CNY 30.000.000	Weigao 4,55% 24/10/2023	30.015.765	0,11				
CNY 28.000.000	XiAn Qujiang Cultural Industry Investment 5,8% 8/12/2023	27.747.762	0,11				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

China Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées CNH
CNH	4.755.659.297	USD	662.745.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(62.182.090)
CNH	4.722.300.971	USD	656.185.000	Bank of America	20/9/2023	(47.824.300)
CNH	4.820.961.214	USD	669.508.206	Deutsche Bank	20/9/2023	(46.011.189)
SGD	7.000.000	USD	5.169.936	Citigroup	20/9/2023	90.597
USD	2.199.008	EUR	2.000.000	Goldman Sachs	20/9/2023	199.850
USD	11.211.466	SGD	15.000.000	Goldman Sachs	20/9/2023	774.897
USD	10.390.127	HKD	81.060.756	Goldman Sachs	20/9/2023	339.436
USD	54.300.000	CNH	396.028.910	JP Morgan	20/9/2023	(1.306.755)
USD	93.300.000	CNH	676.938.150	Citigroup	20/9/2023	1.293.321
USD	100.000.000	CNH	725.510.800	UBS	20/9/2023	1.425.476
USD	134.000.000	CNH	976.665.016	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.579.565)
USD	60.000.000	CNH	436.886.260	Barclays	20/9/2023	(727.724)
Moins-value nette non réalisée						(156.508.046)
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	194.601.328	CNY	914.663.000	BNY Mellon	15/9/2023	2.273.805
CNY	17.242.080	AUD	3.669.822	BNY Mellon	15/9/2023	(49.666)
Plus-value nette non réalisée						2.224.139
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	16.450.647	CNY	88.285.397	BNY Mellon	15/9/2023	147.343
CNY	11.358.260	CAD	2.105.487	BNY Mellon	15/9/2023	40.070
Plus-value nette non réalisée						187.413
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
CNY	55.113.132	EUR	6.947.789	BNY Mellon	15/9/2023	274.316
EUR	301.322.185	CNY	2.386.038.688	BNY Mellon	15/9/2023	(7.697.307)
Moins-value nette non réalisée						(7.422.991)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
CNY	4.444.667	GBP	479.499	BNY Mellon	15/9/2023	24.799
GBP	26.814.005	CNY	246.212.884	BNY Mellon	15/9/2023	956.099
Plus-value nette non réalisée						980.898
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
CNY	84.796.969	HKD	91.049.604	BNY Mellon	15/9/2023	340.398
HKD	1.440.678.689	CNY	1.332.188.095	BNY Mellon	15/9/2023	4.188.837
Plus-value nette non réalisée						4.529.235
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
CNY	295	JPY	5.862	BNY Mellon	15/9/2023	3
JPY	486.756	CNY	24.664	BNY Mellon	15/9/2023	(406)
Moins-value nette non réalisée						(403)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
CNY	762.611	NZD	176.487	BNY Mellon	15/9/2023	(637)
NZD	13.917.780	CNY	60.685.075	BNY Mellon	15/9/2023	(496.635)
Moins-value nette non réalisée						(497.272)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
CNY	71.691.661	SGD	13.329.276	BNY Mellon	15/9/2023	(45.819)
SGD	543.610.999	CNY	2.914.510.346	BNY Mellon	15/9/2023	11.196.038
Plus-value nette non réalisée						11.150.219
Catégorie d'Actions couverte en USD						
CNY	369.889.892	USD	50.759.606	BNY Mellon	15/9/2023	808.065
USD	716.382.266	CNY	5.169.946.496	BNY Mellon	15/9/2023	39.123.903
Plus-value nette non réalisée						39.931.968
Total des moins-values nettes non réalisées (CNH Exposition sous-jacente - CNH 49.486.234.582)						(105.424.840)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Bond Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente CNH	Plus-values/ (moins-values) non réalisées CNH
(2.319)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	1.870.895.766	(15.026.217)
(325)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	274.243.826	(2.438.306)
4.188	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	3.254.250.624	11.777.028
Total				5.399.390.216	(5.687.495)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée CNH	Valeur de marché CNH
643	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.700	15/9/2023	(4.895.717)	835.049
826	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.800	15/9/2023	(5.383.391)	689.598
1.040	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.900	15/9/2023	(7.111.862)	530.602
684	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.300	15/12/2023	(5.242.589)	2.569.711
Total (CNH Exposition sous-jacente - CNH 111.920.481)						(22.633.559)	4.624.960

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée CNH	Valeur de marché CNH
(1.469)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.500	15/9/2023	2.225.707	(68.134)
(1.040)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.600	15/9/2023	1.649.290	(48.237)
(684)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 8.300	15/12/2023	1.481.235	(348.973)
Total (CNH Exposition sous-jacente - CNH 11.884.698)						5.356.232	(465.344)

China Flexible Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				172.800	NARI Technology	565.759	2,59
				56.500	Ping An Insurance of China	338.223	1,54
				31.200	Ping An Insurance of China	209.234	0,96
				17.743	Qingdao Hiron Commercial Cold Chain	42.849	0,20
				45.700	Shenzhen Inovance Technology	428.900	1,96
				11.800	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	437.917	2,00
				11.692	Sungrow Power Supply	160.305	0,73
				27.400	WuXi AppTec	300.098	1,37
				211.500	Yantai Zhenghai Magnetic Material	338.965	1,55
				118.580	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	484.076	2,21
						11.059.789	50,56
ACTIONS ORDINAIRES				Hong Kong			
	Îles Caïmans			54.000	AIA	490.222	2,24
56.900	Alibaba	654.392	2,99	48.000	China Resources Beer	282.138	1,29
7.707	Alibaba	714.901	3,27	44.000	Galaxy Entertainment	291.165	1,33
116.000	China Mengniu Dairy	390.464	1,79			1.063.525	4,86
82.000	China Resources Land	346.590	1,59	Taiwan			
25.800	ENN Energy	202.309	0,92	13.000	Lotes	353.100	1,62
12.638	Kanzhun	191.592	0,87	26.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	448.212	2,05
14.218	KE	244.550	1,12	11.000	Wiwynn	538.834	2,46
24.410	Meituan	399.936	1,83			1.340.146	6,13
2.145	NetEase	224.195	1,03	États-Unis			
28.600	NetEase	597.309	2,73	8.275	Yum China	445.360	2,04
47.500	Tencent	1.968.321	9,00	Total des actions ordinaires			
		5.934.559	27,14			19.843.379	90,73
Chine				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
113.990	Anhui Honglu Steel Construction	419.902	1,92	Total du portefeuille			
131.990	Bank of Ningbo	474.778	2,17			19.843.379	90,73
112.015	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology	442.188	2,02	Autres éléments de l'actif net			
64.100	Beijing Tongrentang	495.330	2,26	Total de l'actif net (USD)			
14.500	BYD	454.432	2,08			2.027.459	9,27
114.500	China Merchants Bank	452.570	2,07	Total de l'actif net (USD)			
63.500	China Merchants Bank	275.371	1,26			21.870.838	100,00
412.000	China Oilfield Services	467.001	2,14				
826.000	China Petroleum & Chemical	483.406	2,21				
13.055	China Tourism Duty Free	195.448	0,89				
170.800	China Yangtze Power	517.892	2,37				
14.760	Contemporary Amperex Technology	479.905	2,19				
27.200	Ganfeng Lithium	130.053	0,59				
19.000	Haier Smart Home	61.398	0,28				
146.800	Haier Smart Home*	453.896	2,08				
100.600	Hangzhou Oxygen Plant	423.260	1,94				
35.850	Hangzhou Silan Microelectronics	124.915	0,57				
4.700	Kweichow Moutai	1.193.193	5,46				
57.141	LONGi Green Energy Technology	208.525	0,95				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

China Flexible Equity Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	6.046.766	USD	6.631.459	BNY Mellon	15/9/2023	(67.519)
USD	669.764	EUR	613.735	BNY Mellon	15/9/2023	3.538
Moins-value nette non réalisée						(63.981)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 7.226.322)						(63.981)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Moins-value non réalisée USD
Pays-Bas			
1.399	Prosus	JP Morgan	(3.661)
			(3.661)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 97.795)			(3.661)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Communications	17,96
Biens de consommation non cyclique	14,17
Valeurs industrielles	14,07
Finance	12,95
Biens de consommation cyclique	10,89
Technologie	8,84
Énergie	6,03
Services aux collectivités	3,29
Matériaux de base	2,53
Autres éléments de l'actif net	9,27
	100,00

China Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				3.474.115	CMOC	2.736.181	0,27
COMPARTIMENTS				840.318	Contemporary Amperex Technology	27.322.008	2,68
États-Unis				1.662.800	Ganfeng Lithium	7.950.425	0,78
607.300	iShares Gold Trust [~]	22.354.713	2,19	3.882.600	Haier Smart Home	12.004.759	1,17
Total des Compartiments				71.845	Kweichow Moutai	18.239.353	1,79
				6.448.500	Ping An Insurance of China*	38.602.315	3,78
				18.559.000	Postal Savings Bank of China	9.157.661	0,90
				1.120.736	Shenzhen Inovance Technology	10.518.234	1,03
				303.762	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	11.273.096	1,10
ACTIONS ORDINAIRES				1.154.237	Sungrow Power Supply	15.825.370	1,55
Îles Caïmans				1.534.000	Tsingtao Brewery	12.781.741	1,25
8.305.512	Alibaba	95.519.490	9,36	1.045.600	WuXi AppTec	11.713.028	1,15
52.417	Alibaba	4.862.201	0,48	6.777.300	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	27.666.814	2,71
63.932	Baidu*	9.125.654	0,90	370.748.063 36,33			
1.253.666	Baidu	22.282.487	2,18	Hong Kong			
3.123.000	China Mengniu Dairy	10.512.232	1,03	1.724.600	AIA	15.656.238	1,53
2.162.000	China Resources Land	9.138.150	0,90	2.418.000	China Resources Beer	14.212.690	1,39
455.400	China Resources Mixc Lifestyle Services	1.965.490	0,19	13.670.000	Lenovo	15.460.060	1,52
1.308.700	ENN Energy	10.262.054	1,01	45.328.988 4,44			
4.072.500	Longfor*	8.578.082	0,84	Pays-Bas			
3.239.638	Meituan	53.078.503	5,20	152.997	Prosus	10.694.952	1,05
97.340	NetEase	10.173.977	1,00	Taiwan			
1.873.000	NetEase	39.117.467	3,83	224.000	Asia Vital Components	2.352.784	0,23
475.960	New Oriental Education & Technology	25.825.590	2,53	271.000	eMemory Technology	15.444.855	1,51
297.946	PDD	29.636.689	2,91	915.000	Lotes	24.852.788	2,44
5.345.200	Sands China*	18.094.539	1,77	100.000	Wiwynn	4.898.494	0,48
1.936.586	Tencent	80.248.920	7,87	47.548.921 4,66			
1.699.712	Tencent Music Entertainment	11.668.523	1,14	États-Unis			
839.222	Trip.com*	33.199.622	3,25	534.994	Yum China	28.747.351	2,82
191.900	Trip.com	7.570.322	0,74	Total des actions ordinaires			
480.859.992 47,13				983.928.267 96,43			
Chine				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
432.668	Asymchem Laboratories Tianjin	7.912.535	0,78	1.006.282.980 98,62			
996.500	BYD	31.230.449	3,06	Total du portefeuille			
82.628.000	China Construction Bank	44.248.197	4,34	1.006.282.980 98,62			
45.782.000	China Datang Renewable Power	11.382.782	1,11	Autres éléments de l'actif net			
2.402.500	China Merchants Bank	9.496.075	0,93	14.049.722 1,38			
15.398.000	China Oilfield Services	17.453.604	1,71	Total de l'actif net (USD)			
30.980.000	China Petroleum & Chemical	18.130.641	1,78	1.020.332.702 100,00			
4.012.500	CITIC	7.837.776	0,77				
2.757.885	CITIC	8.415.407	0,82				
14.799.000	CMOC	8.849.612	0,87				

[~] Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

China Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	58.290.514	USD	37.941.961	BNY Mellon	15/9/2023	(168.830)
USD	6.276.835	AUD	9.710.908	BNY Mellon	15/9/2023	(15.960)
Moins-value nette non réalisée						(184.790)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	251.481.154	USD	34.803.204	BNY Mellon	15/9/2023	(217.222)
USD	4.419.717	CNY	32.135.788	BNY Mellon	15/9/2023	125
Moins-value nette non réalisée						(217.097)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	67.137.515	USD	73.618.676	BNY Mellon	15/9/2023	(738.954)
USD	9.794.321	EUR	8.977.553	BNY Mellon	15/9/2023	48.954
Moins-value nette non réalisée						(690.000)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	26.216.990	USD	33.345.376	BNY Mellon	15/9/2023	(109.742)
USD	4.577.597	GBP	3.602.507	BNY Mellon	15/9/2023	10.652
Moins-value nette non réalisée						(99.090)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	25.727.619	USD	19.107.040	BNY Mellon	15/9/2023	(64.167)
USD	2.630.225	SGD	3.558.979	BNY Mellon	15/9/2023	(4.028)
Moins-value nette non réalisée						(68.195)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 224.998.435)						(1.259.172)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Moins-value non réalisée USD
Chine			
9.648.900	CMOC	Goldman Sachs	(121.393)
54.720	Contemporary Ampere Technology	HSBC Bank	(90.838)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 9.360.280)			(212.231)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Communications	35,08
Finance	15,00
Biens de consommation cyclique	11,50
Biens de consommation non cyclique	11,02
Technologie	8,57
Valeurs industrielles	6,18
Énergie	5,04
Fonds d'investissement	2,19
Services aux collectivités	2,12
Matériaux de base	1,92
Autres éléments de l'actif net	1,38
	100,00

China Impact Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				184.600	Ming Yang Smart Energy	378.824	1,47
ACTIONS ORDINAIRES				329.380	NARI Technology	1.078.413	4,18
Bermudes				32.244	Ningbo Ronbay New Energy Technology	225.763	0,87
1.942.000	China Water Affairs	1.490.612	5,78	1.007.000	Postal Savings Bank of China	496.889	1,93
Îles Caïmans				812.200	Postal Savings Bank of China	542.557	2,10
62.220	Chailease	346.790	1,34	170.821	Shandong Head	403.142	1,56
203.600	Hygeia Healthcare	1.029.295	3,99	226.100	Shandong Sinocera Functional Material	927.664	3,60
42.405	Kanzhun	642.860	2,49	23.946	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	888.675	3,44
		2.018.945	7,82	91.684	Sungrow Power Supply	1.257.050	4,87
Chine				60.225	WuXi AppTec	674.653	2,61
319.330	Aier Eye Hospital	790.934	3,07	53.200	WuXi AppTec	582.672	2,26
245.704	Anhui Honglu Steel Construction	905.093	3,51	355.154	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	1.449.837	5,62
25.440	Asymchem Laboratories Tianjin	320.474	1,24	333.033	Zhejiang Weixing New Building Materials	925.123	3,58
35.400	Bethel Automotive Safety Systems	366.682	1,42			19.460.346	75,42
19.500	BYD	668.463	2,59	Taiwan			
3.035.000	China Datang Renewable Power	754.592	2,93	160.000	Merida Industry	969.650	3,76
271.600	China Yangtze Power	823.534	3,19	Total des actions ordinaires			
37.460	Contemporary Amperex Technology	1.217.970	4,72			23.939.553	92,78
173.000	Flat Glass	429.689	1,67	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
106.460	Ganfeng Lithium	693.749	2,69			23.939.553	92,78
156.038	Glodon	526.321	2,04	Total du portefeuille			
93.840	Guangdong Haid	622.216	2,41			23.939.553	92,78
172.701	Hongfa Technology	833.672	3,23	Autres éléments de l'actif net			
337.400	Jiangsu Zhongtian Technology	675.695	2,62			1.863.127	7,22
				Total de l'actif net (USD)			
						25.802.680	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Impact Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	3.358.991	USD	3.684.475	BNY Mellon	15/9/2023	(38.193)
USD	412.605	EUR	378.309	BNY Mellon	15/9/2023	1.942
Moins-value nette non réalisée						(36.251)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 4.054.789)						(36.251)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Valeurs industrielles	28,52
Biens de consommation non cyclique	19,02
Biens de consommation cyclique	12,49
Énergie	8,88
Matériaux de base	7,85
Services aux collectivités	6,12
Finance	5,37
Communications	2,49
Technologie	2,04
Autres éléments de l'actif net	7,22
	100,00

China Innovation Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				3.400	Harmonic Drive Systems	89.214	0,43
ACTIONS ORDINAIRES				5.300	Ibiden	318.823	1,53
Australie				300	Keyence	124.224	0,60
11.685	Altium	366.414	1,77	1.800	Lasertec	279.258	1,34
87.294	SiteMinder	276.504	1,33	4.600	M3	91.383	0,44
3.471	WiseTech Global	156.260	0,75	6.000	Nexon	121.392	0,59
		799.178	3,85	21.500	Nikon	231.542	1,12
Îles Caïmans				16.200	Renesas Electronics	271.617	1,31
6.000	Alchip Technologies	465.357	2,24	2.500	Rohm	208.169	1,00
51.036	Alibaba	586.952	2,82	4.893	Sony*	407.000	1,96
31.100	ASMPT	311.477	1,50			3.283.255	15,80
23.750	Baidu	422.129	2,03	Kazakhstan			
6.494	Kanzhun	98.449	0,47	5.141	Kaspi.KZ JSC	534.664	2,57
9.700	Meituan	158.926	0,77	Nouvelle-Zélande			
21.300	NetEase	444.849	2,14	3.535	Xero	286.454	1,38
3.019	New Oriental Education & Technology	163.811	0,79	Corée du Sud			
3.446	PDD	342.774	1,65	2.820	Kakao	102.623	0,50
16.400	Tencent	679.589	3,27	882	NAVER	143.135	0,69
23.905	Tencent Music Entertainment	164.108	0,79	8.825	Samsung Electronics	446.675	2,15
91.600	Tongcheng Travel	205.321	0,99	735	Samsung SDI	341.434	1,64
16.250	Trip.com	641.051	3,09	3.434	SK Hynix	316.445	1,52
		4.684.793	22,55			1.350.312	6,50
Chine				Taiwan			
4.845	Advanced Micro-Fabrication Equipment China	101.450	0,49	44.000	Accton Technology	660.417	3,18
4.686	Beijing Huafeng Test & Control Technology	90.559	0,43	16.000	AP Memory Technology	164.790	0,79
7.979	Beijing Kingsoft Office Software	432.765	2,08	53.000	ASE Technology	196.379	0,95
13.000	BYD	407.422	1,96	23.000	Asia Vital Components	241.580	1,16
502.000	China Datang Renewable Power	124.812	0,60	5.400	ASPEED Technology	457.821	2,20
9.480	Contemporary Amperex Technology	308.232	1,48	37.000	Delta Electronics	401.991	1,93
362.000	CRRC	178.162	0,86	5.000	eMemory Technology	284.960	1,37
45.000	IKD	153.085	0,74	3.000	Global Unichip	137.535	0,66
115.224	NARI Technology	377.251	1,81	12.311	Lotes	334.385	1,61
37.920	Shanghai Baosight Software	249.817	1,20	13.000	Phison Electronics	172.876	0,83
30.500	Shenzhen Inovance Technology	286.246	1,38	68.000	Quanta Computer	541.283	2,60
3.022	Shenzhen Transsion	60.985	0,29	56.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	965.380	4,65
18.300	Sungrow Power Supply	250.905	1,21	71.000	Unimicron Technology	413.562	1,99
24.364	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical	188.640	0,91	88.000	Wistron	323.301	1,56
43.200	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	176.355	0,85	7.000	Wiwynn	342.895	1,65
13.100	Zhongji Innolight	206.385	0,99	15.000	Yageo	228.439	1,10
		3.593.071	17,28			5.867.594	28,23
Japon				États-Unis			
25.600	Appier	310.202	1,49	12.435	Coupang	234.400	1,13
2.000	Disco	393.350	1,89	Total des actions ordinaires			
11.300	Freee	235.038	1,13			20.633.721	99,29
3.200	GMO Payment Gateway	202.043	0,97	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
						20.633.721	99,29
Total du portefeuille				Total de l'actif net (USD)			
						20.782.256	100,00
Autres éléments de l'actif net				Total de l'actif net (USD)			
						148.535	0,71
Total de l'actif net (USD)				Total de l'actif net (USD)			
						20.782.256	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

China Innovation Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	471.508	USD	65.307	BNY Mellon	15/9/2023	(460)
USD	5.612	CNY	40.760	BNY Mellon	15/9/2023	7
Moins-value nette non réalisée						(453)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 70.268)						(453)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Technologie	48,14
Communications	23,75
Valeurs industrielles	15,21
Biens de consommation cyclique	7,13
Biens de consommation non cyclique	3,25
Énergie	1,21
Services aux collectivités	0,60
Autres éléments de l'actif net	0,71
	100,00

China Multi-Asset Fund⁽²⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				80.800	China Petroleum & Chemical	67.413	0,34
				30.100	China Southern Airlines	26.147	0,13
				139.500	China State Construction Engineering	107.951	0,55
				300	China Tourism Duty Free	4.491	0,02
				19.900	China United Network Communications	14.251	0,07
				145.100	China Vanke	169.281	0,87
				45.400	CITIC	138.533	0,71
				2.700	Contemporary Amperex Technology	87.787	0,45
				66.000	Dongfeng Motor	24.236	0,12
				28.212	ENN Natural Gas	67.706	0,35
				170.400	Goldwind Science & Technology	89.513	0,46
				123.600	Goldwind Science & Technology	161.394	0,83
				34.700	Gree Electric Appliances of Zhuhai	170.701	0,88
				3.900	Haier Smart Home	12.603	0,06
				5.800	Heilongjiang Agriculture	10.699	0,06
				13.800	Hisense Home Appliances	46.510	0,24
				126.000	Industrial & Commercial Bank of China	57.835	0,30
				7.900	Industrial Bank	17.167	0,09
				42.500	Inner Mongolia MengDian	19.803	0,10
				53.600	Inner Mongolia Yili Industrial	191.551	0,98
				1.300	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals	7.465	0,04
				5.400	Jiangsu King's Luck Brewery JSC	44.460	0,23
				300	Kweichow Moutai	76.161	0,39
				5.900	Laobaixing Pharmacy Chain JSC	20.809	0,11
				27.600	Lingyi iTech Guangdong	22.838	0,12
				16.500	Midea	128.161	0,66
				300	NAURA Technology	11.186	0,06
				93.600	Offshore Oil Engineering	74.877	0,38
				29.000	Ping An Insurance of China	173.601	0,89
				22.200	Ping An Insurance of China	148.878	0,76
				24.000	Postal Savings Bank of China	11.842	0,06
				36.700	Shanghai Pharmaceuticals	90.194	0,46
				14.400	Shanghai Tunnel Engineering	11.579	0,06
				128.100	Shanghai Yuyuan Tourist Mart	129.590	0,66
				5.900	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	218.958	1,12
				3.700	Shenzhen New Energy Technology	45.049	0,23
				44.200	Sichuan Kelun Pharmaceutical	164.641	0,84
				38.700	Tasly Pharmaceutical	73.939	0,38
				1.000	Tsingtao Brewery	12.522	0,06
				90.900	Weichai Power	147.432	0,76
				1.400	Wuliangye Yibin	30.002	0,15
				31.700	Yunnan Copper	50.630	0,26
				87.900	Yutong Bus	150.661	0,77
				38.400	ZTE	187.108	0,96
						4.383.450	22,46
				États-Unis			
				1.796	Yum China	96.661	0,50
				Total des actions ordinaires		6.729.338	34,50
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		18.553.279	95,11
				Total du portefeuille		18.553.279	95,11
				Autres éléments de l'actif net		954.022	4,89
				Total de l'actif net (USD)		19.507.301	100,00
				COMPARTIMENTS			
				Irlande			
31.947	BlackRock ICS US Treasury Fund [*]	3.534.360	18,12				
				Luxembourg			
157.017	BlackRock Global Funds - China Impact Fund ^{**}	1.496.369	7,67				
333.361	BlackRock Global Funds - China Onshore Bond Fund ^{**}	3.473.620	17,81				
154.589	BlackRock Global Funds - Systematic China Environmental Tech Fund ^{**}	1.508.792	7,73				
19.827	Lyxor MSCI China ESG Leaders Extra DR UCITS ETF	1.810.800	9,28				
		8.289.581	42,49				
	Total des Compartiments	11.823.941	60,61				
				ACTIONS ORDINAIRES			
				Îles Caïmans			
34.300	Alibaba	394.475	2,02				
750	Baidu	13.330	0,07				
1.244	Baozun	4.964	0,03				
200	BeiGene	3.244	0,02				
83.000	China Lesso	45.717	0,23				
8.000	China Medical System	11.547	0,06				
140.000	China Yuhua Education	14.816	0,08				
41.000	Fufeng	21.799	0,11				
155.000	Geely Automobile	192.490	0,99				
216	H World	8.731	0,04				
573	Hello	5.088	0,03				
11.500	HUTCHMED China	35.337	0,18				
4.304	I-Mab	8.565	0,04				
3.000	JD.com	49.267	0,25				
16.200	Kuaishou Technology	132.608	0,68				
2.400	Li Auto	49.451	0,25				
2.100	Meituan	34.407	0,18				
1.688	MINISO	43.956	0,23				
270	NetEase	28.220	0,14				
4.000	NetEase	83.540	0,43				
3.100	New Oriental Education & Technology	16.739	0,09				
467	NIO	4.962	0,03				
593	PDD	58.986	0,30				
17.200	Tencent	712.740	3,65				
1.100	Trip.com	43.394	0,22				
6.132	Vipshop	97.253	0,50				
4.500	Wuxi Biologics Cayman	25.332	0,13				
193.000	Xiabuxiabu Catering Management China	93.264	0,48				
1.600	XPeng	15.005	0,08				
		2.249.227	11,54				
				Chine			
250.000	Bank of Communications	143.122	0,73				
15.500	Beijing Yanjing Brewery	22.114	0,11				
200.900	BOE Technology	110.731	0,57				
4.100	BYD	140.549	0,72				
23.900	By-health	63.500	0,33				
168.000	China Construction Bank	89.966	0,46				
39.000	China Merchants Bank	154.151	0,79				
13.600	China Merchants Bank	58.977	0,30				
22.600	China Pacific Insurance	51.753	0,27				
52.000	China Petroleum & Chemical	30.432	0,16				

[∞] Participation croisée d'un fonds à compartiments multiples et investissement dans le fonds d'une partie liée, pour de plus amples informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.
^{*} Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Multi-Asset Fund⁽²⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Moins-value non réalisée USD
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	36.848	USD	5.107	BNY Mellon	15/9/2023	(39)
USD	247	CNY	1.796	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(39)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	40.049	USD	5.132	BNY Mellon	15/9/2023	(22)
USD	249	HKD	1.945	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(22)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 10.655)						(61)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
(95)	USD	MSCI China Index	Septembre 2023	2.181.200	79.705
5	USD	SGX FTSE China A50 Index	Septembre 2023	63.255	31
Total				2.244.455	79.736

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	CNY 1.000.000	Fund receives Fixed 2,26%; and pays Floating CNY CNRR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2028	(295)	(295)
IRS	CNY 1.000.000	Fund receives Fixed 2,45%; and pays Floating CNY CNRR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2028	936	936
IRS	CNY 50.000.000	Fund receives Fixed 2,458%; and pays Floating CNY CNRR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2028	49.404	49.404
IRS	CNY 4.000.000	Fund receives Floating CNY CNRR 3 Month; and pays Fixed 2,255%	BNP Paribas	20/9/2028	1.312	1.312
IRS	CNY 2.000.000	Fund receives Floating CNY CNRR 3 Month; and pays Fixed 2,422%	BNP Paribas	20/9/2028	(1.509)	(1.509)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 8.004.369)					49.848	49.848

IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Onshore Bond Fund⁽²⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (CNH)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				CNY 10.000.000	China Energy Conservation & Environmental Protection 3,52% 15/4/2025	10.117.625	1,33
OBLIGATIONS				CNY 10.000.000	China Government Bond 2,68% 21/5/2030	10.081.112	1,33
Bermudes				CNY 20.000.000	China Government Bond 2,91% 14/10/2028	20.466.566	2,69
USD 200.000	China Oil & Gas 4,7% 30/6/2026	1.218.694	0,16	CNY 9.000.000	China Government Bond 3,12% 25/10/2052	9.337.202	1,23
USD 250.000	Luye Pharma 6,25% 6/7/2028	1.633.931	0,21	CNY 10.000.000	China Government Bond 3,19% 15/4/2053	10.592.849	1,39
		2.852.625	0,37	CNY 2.000.000	China Government Bond 3,53% 18/10/2051	2.229.511	0,29
Îles Vierges britanniques				CNY 5.000.000	China Government Bond 3,72% 12/4/2051	5.751.027	0,76
USD 200.000	Central Plaza Development 3,85% 14/7/2025	1.117.967	0,15	CNY 10.000.000	China Life Reinsurance 4,8% 29/11/2028	10.049.800	1,32
USD 200.000	Central Plaza Development 4,65% 19/1/2026	1.083.147	0,14	USD 750.000	China Merchants Bank 1,2% 10/9/2025	5.008.507	0,66
USD 200.000	China Cinda 2020 I Management 5,75% 7/2/2027	1.431.746	0,19	CNY 10.000.000	China Merchants Commerce Financial Leasing 3,43% 22/8/2027	10.125.775	1,33
USD 200.000	Franshion Brilliant 4% 21/6/2024	1.338.665	0,18	CNY 700.000	China Merchants Expressway Network & Technology 1,5% 22/3/2025	895.965	0,12
HKD 2.000.000	Link CB 1,6% 3/4/2024	1.801.914	0,24	CNY 10.000.000	China Railway 3,34% 28/5/2024	10.067.087	1,32
USD 200.000	Peak RE Bvi 5,35% 28/10/2025	1.219.043	0,16	CNY 400.000	China Southern Airlines 0,6% 15/10/2026	519.722	0,07
USD 200.000	SND International Bvi 2,7% 14/12/2023	1.439.734	0,19	CNY 1.500.000	China Three Gorges 0,1% 1/6/2027	1.680.023	0,22
USD 200.000	Vertex Capital Investment 4,75% 3/4/2024	1.431.629	0,19	CNY 500.000	China Three Gorges 0,5% 9/4/2024	738.750	0,10
USD 200.000	Zhongyuan Sincere Investment 4,25% 28/6/2024	1.431.368	0,19	CNY 10.000.000	China Three Gorges 4,09% 3/12/2023	10.057.507	1,32
		12.295.213	1,63	CNY 500.000	Chongqing Longhu Development 3,8% 4/3/2027	400.273	0,05
Îles Caïmans				CNY 500.000	Chongqing Longhu Development 4,2% 17/1/2027	405.157	0,05
USD 200.000	AAC Technologies 2,625% 2/6/2026	1.214.984	0,16	CNY 1.000.000	Chongqing Longhu Development 4,67% 19/7/2026	891.290	0,12
USD 300.000	Baidu 2,375% 23/8/2031	1.735.226	0,23	CNY 10.000.000	Chongqing Rail Transit 3,79% 9/3/2024	10.078.912	1,33
USD 200.000	CDBL Funding 1 3,5% 24/10/2027	1.364.012	0,18	CNY 10.000.000	Chongqing Rail Transit 4,09% 20/9/2024	10.130.176	1,33
USD 200.000	China Overseas Finance Cayman VIII 3,05% 27/11/2029	1.237.967	0,16	CNY 20.000.000	Contemporary Amperex Technology 2,9% 14/12/2027	20.021.450	2,63
USD 800.000	ENN Energy 4,625% 17/5/2027	5.669.559	0,75	CNY 10.000.000	DBS Bank China 4,7% 24/3/2031	10.318.375	1,36
USD 400.000	Geely Automobile 4% 9/12/2024	2.777.875	0,36	CNY 10.000.000	Guangzhou Communications Investment 3,25% 12/7/2024	10.077.670	1,33
USD 200.000	Zhongsheng 3% 13/1/2026	1.331.527	0,18	CNY 10.000.000	Guangzhou Metro 2,74% 30/4/2025	10.046.975	1,32
		15.331.150	2,02	CNY 10.000.000	Guotai Junan Securities 4,2% 31/12/2079	10.169.325	1,34
Chine				USD 200.000	Henan Railway Construction & Investment 2,2% 26/1/2025	1.370.938	0,18
CNY 10.000.000	Bank of China 2,6% 23/2/2025	10.018.659	1,32	CNY 10.000.000	Huadian New Energy 3,08% 9/11/2024	10.077.945	1,32
CNY 10.000.000	Bank of China 3,25% 24/1/2032	10.081.858	1,33	CNY 10.000.000	Huatai 3,23% 6/2/2026	10.149.235	1,33
CNY 10.000.000	Bank of Communications 2,42% 9/8/2025	9.984.508	1,31	CNY 10.000.000	Hubei Provincial Communications Investment 3,75% 22/3/2024	10.078.480	1,33
CNY 10.000.000	Bank of Communications 3,45% 25/2/2032	10.186.115	1,34	CNY 10.000.000	Huzhou City Investment Development 3,32% 9/11/2026	10.075.500	1,33
CNY 2.000.000	Bank of Shanghai 1,5% 25/1/2027	2.184.710	0,29	CNY 10.000.000	Industrial & Commercial Bank of China 2,6% 10/6/2025	10.013.800	1,32
CNY 10.000.000	Beijing Capital Development 3,76% 22/9/2027	10.050.400	1,32				
CNY 10.000.000	Beijing Infrastructure Investment 4,15% 11/9/2024	10.163.195	1,34				
CNY 10.000.000	Chengdu Rail Transit 3,97% 15/3/2027	10.290.625	1,35				
CNY 10.000.000	China Construction Bank 3,45% 17/6/2032	10.161.650	1,34				
CNY 50.000.000	China Development Bank 2,19% 14/12/2024	50.012.208	6,58				

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Onshore Bond Fund⁽²⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées CNH
CNH	41.260.275	USD	5.750.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(538.394)
CNH	40.984.637	USD	5.695.000	Bank of America	20/9/2023	(414.218)
CNH	41.858.290	USD	5.813.288	Barclays	20/9/2023	(400.441)
USD	374.463	SGD	501.000	Goldman Sachs	20/9/2023	25.829
USD	281.989	HKD	2.200.000	Goldman Sachs	20/9/2023	9.194
USD	32.018	HKD	250.000	UBS	20/9/2023	854
USD	2.560.000	CNH	18.574.080	Citigroup	20/9/2023	35.414
USD	2.500.000	CNH	18.227.472	Barclays	20/9/2023	(54.138)
Moins-value nette non réalisée						(1.335.900)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	9.546	CNY	75.593	BNY Mellon	15/9/2023	(243)
Moins-value nette non réalisée						(243)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
CNY	779.316	HKD	835.595	BNY Mellon	15/9/2023	4.221
HKD	11.866.219	CNY	10.972.637	BNY Mellon	15/9/2023	34.426
Plus-value nette non réalisée						38.647
Catégorie d'Actions couverte en USD						
CNY	2.520.527	USD	345.555	BNY Mellon	15/9/2023	7.930
USD	82.642.368	CNY	596.402.906	BNY Mellon	15/9/2023	4.509.956
Plus-value nette non réalisée						4.517.886
Total des plus-values nettes non réalisées (CNH Exposition sous-jacente - CNH 1.397.229.602)						3.220.390

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente CNH	Plus-values/ (moins-values) non réalisées CNH
(12)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	10.125.926	(90.030)
108	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	83.920.503	282.818
Total				94.046.429	192.788

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée CNH	Valeur de marché CNH
16	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.700	15/9/2023	(95.022)	20.779
21	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.800	15/9/2023	(105.532)	17.532
26	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.900	15/9/2023	(177.797)	13.265
19	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.300	15/12/2023	(145.626)	71.381
Total (CNH Exposition sous-jacente - CNH 2.907.896)						(523.977)	122.957

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

China Onshore Bond Fund⁽²⁾ suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée CNH	Valeur de marché CNH
(37)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.500	15/9/2023	38.934	(1.716)
(26)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.600	15/9/2023	41.234	(1.206)
(19)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 8.300	15/12/2023	41.145	(9.694)
Total (CNH Exposition sous-jacente - CNH 316.525)						121.313	(12.616)

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Circular Economy Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé									
ACTIONS ORDINAIRES									
Australie				Suède					
5.538.693	Brambles	53.707.833	3,23	1.342.528	Epiroc*	25.917.145	1,56		
14.131.398	Cleanaway Waste Management	23.982.528	1,44	188.762	Re:NewCell*	1.600.523	0,09		
1.475.137	Sims	14.657.714	0,88				27.517.668	1,65	
				Suisse					
				292.628	Nestle	35.365.479	2,12		
				1.882.219	SIG*	50.251.661	3,02		
				129.771	Sika*	36.879.740	2,22		
							122.496.880	7,36	
				Royaume-Uni					
				952.641	Coca-Cola Europacific Partners	61.835.927	3,72		
				États-Unis					
				376.749	AECOM*	33.300.844	2,00		
				212.174	Agilent Technologies*	26.080.428	1,57		
				234.120	Carbios SACA	6.375.585	0,38		
				260.949	Avery Dennison	49.319.361	2,97		
				1.161.149	Dassault Systemes	46.234.038	2,78		
				103.799	L'Oreal	46.217.701	2,78		
				219.578	Schneider Electric*	37.992.937	2,28		
				1.909.449	Veolia Environnement	59.684.167	3,59		
							41.397.149	2,49	
							863.864	2,79	
							219.162	4,33	
							130.235	1,34	
							454.256	3,98	
							66.940	2,26	
							419.312	2,33	
							631.406	2,70	
							259.872	2,47	
							489.712	3,07	
							112.627	1,89	
							748.631.113	45,01	
							1.628.169.283	97,89	
				Total des actions ordinaires				1.628.169.283	97,89
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				1.628.169.283	97,89
				Total du portefeuille				1.628.169.283	97,89
				Autres éléments de l'actif net				35.072.409	2,11
				Total de l'actif net (USD)				1.663.241.692	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Circular Economy Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	730.684	USD	475.797	BNY Mellon	15/9/2023	(2.301)
USD	27.411	AUD	42.425	BNY Mellon	15/9/2023	(81)
Moins-value nette non réalisée						(2.382)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	1.086.692	USD	807.936	BNY Mellon	15/9/2023	(4.543)
USD	104.078	CAD	140.776	BNY Mellon	15/9/2023	2
Moins-value nette non réalisée						(4.541)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	1.579.045	USD	218.710	BNY Mellon	15/9/2023	(1.545)
USD	12.389	CNY	90.015	BNY Mellon	15/9/2023	9
Moins-value nette non réalisée						(1.536)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	2.750.760	USD	3.017.171	BNY Mellon	15/9/2023	(31.140)
USD	174.668	EUR	160.089	BNY Mellon	15/9/2023	887
Moins-value nette non réalisée						(30.253)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	7.690.210	USD	9.784.061	BNY Mellon	15/9/2023	(35.078)
USD	715.774	GBP	563.273	BNY Mellon	15/9/2023	1.707
Moins-value nette non réalisée						(33.371)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	23.247.018	USD	2.978.261	BNY Mellon	15/9/2023	(12.607)
USD	323.039	HKD	2.528.387	BNY Mellon	15/9/2023	489
Moins-value nette non réalisée						(12.118)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	40.689.975.011	USD	285.430.956	BNY Mellon	15/9/2023	(6.525.600)
USD	23.364.222	JPY	3.381.026.051	BNY Mellon	15/9/2023	189.939
Moins-value nette non réalisée						(6.335.661)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	124.449	USD	75.153	BNY Mellon	15/9/2023	(1.136)
USD	4.325	NZD	7.251	BNY Mellon	15/9/2023	13
Moins-value nette non réalisée						(1.123)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	839.156	USD	623.345	BNY Mellon	15/9/2023	(2.224)
USD	43.904	SGD	59.365	BNY Mellon	15/9/2023	(38)
Moins-value nette non réalisée						(2.262)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 320.822.690)						(6.423.247)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Valeurs industrielles	39,67
Biens de consommation non cyclique	23,35
Matériaux de base	12,19
Technologie	11,92
Biens de consommation cyclique	7,17
Services aux collectivités	3,59
Autres éléments de l'actif net	2,11
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Climate Action Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie				Pays-Bas			
45.498	Cleanaway Waste Management	77.215	1,69	1.663	STMicroelectronics	79.270	1,74
4.187	Sims	41.604	0,91	Norvège			
		118.819	2,60	1.696	Salmar	82.659	1,81
Bermudes				Corée du Sud			
1.069	Bunge	122.603	2,69	129	LG Chem	56.900	1,25
Canada				131	Samsung SDI	60.854	1,33
1.836	Canadian Solar	52.326	1,15	117.754 2,58			
2.679	Growth International	114.776	2,51	Espagne			
2.409	Maple Leaf Foods	52.904	1,16	9.922	EDP Renovaveis	182.787	4,00
1.069	Nutrien	68.715	1,50	Suède			
3.956	SunOpta	17.723	0,39	19.970	Orron Energy	16.629	0,37
		306.444	6,71	Suisse			
Chine				648	DSM-Firmenich	59.928	1,31
1.500	Contemporary Amperex Technology	48.771	1,07	362	SGS	32.871	0,72
Danemark				3.525	SIG	94.111	2,06
2.854	Vestas Wind Systems	66.334	1,45	186.910 4,09			
Finlande				Royaume-Uni			
2.462	UPM-Kymmene	84.889	1,86	336	Spirax-Sarco Engineering	43.296	0,95
France				États-Unis			
3.097	Bureau Veritas	83.699	1,83	762	AECOM	67.353	1,48
1.115	Dassault Systemes	44.397	0,97	569	AGCO	74.573	1,63
87	Robertet	80.515	1,77	207	Albemarle	41.162	0,90
391	Schneider Electric	67.654	1,48	421	Analog Devices	76.677	1,68
3.301	Veolia Environnement	103.180	2,26	159	ANSYS	50.482	1,11
		379.445	8,31	790	Archer-Daniels-Midland	63.461	1,39
Allemagne				206	Autodesk	45.806	1,00
2.036	Infineon Technologies	73.248	1,60	269	Avery Dennison	50.841	1,11
799	Symrise*	83.792	1,84	904	Crown	84.018	1,84
		157.040	3,44	1.248	Darling Ingredients	78.624	1,72
Islande				390	Deere	161.464	3,54
5.991	Marel	21.580	0,47	618	Ecolab	114.281	2,50
Irlande				357	First Solar	67.327	1,47
1.307	Kerry	122.375	2,68	817	FMC	71.635	1,57
904	Kingspan	76.306	1,67	1.079	Ingersoll Rand	75.422	1,65
1.551	Smurfit Kappa	65.678	1,44	545	John Bean Technologies	59.950	1,31
		264.359	5,79	2.621	NextEra Energy	176.996	3,88
Île de Man				236	Quanta Services	49.985	1,09
331.357	Agronomics	40.408	0,89	767	Republic Services	111.798	2,45
Italie				268	Rogers	38.605	0,85
20.990	Enel	142.012	3,11	341	Union Pacific	75.876	1,66
Japon				633	Waste Management	100.140	2,19
100	Keyence	41.408	0,91	774	Xylem	80.558	1,77
1.000	Kurita Water Industries	38.883	0,85	1.817.034 39,79			
		80.291	1,76	Total des actions ordinaires			
				4.359.334 95,48			
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
				4.359.334 95,48			
				Total du portefeuille			
				4.359.334 95,48			
				Autres éléments de l'actif net			
				206.582 4,52			
				Total de l'actif net (USD)			
				4.565.916 100,00			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Climate Action Equity Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Valeurs industrielles	33,02
Matériaux de base	16,79
Biens de consommation non cyclique	16,59
Services aux collectivités	13,62
Technologie	8,10
Énergie	4,07
Communications	1,33
Biens de consommation cyclique	1,07
Finance	0,89
Autres éléments de l'actif net	4,52
	100,00

Climate Action Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
1.500	Shanghai Fosun Pharmaceutical	3.254	0,01	16.000	Lenovo	16.679	0,04
290	Shanghai Putailai New Energy Technology	1.202	0,00	300	Link REIT	1.371	0,00
700	Sungrow Power Supply	8.846	0,02	6.500	MTR	25.017	0,06
1.400	WuXi AppTec	14.133	0,03	7.000	New World Development	13.705	0,03
3.500	Yunnan Baiyao	24.232	0,05	1.500	Sun Hung Kai Properties	15.566	0,04
1.300	Zhuzhou CRRC Times Electric	4.178	0,01	14.000	Swire Properties	26.983	0,06
		557.043	1,22			109.806	0,25
	Danemark				Islande		
52	Chr Hansen	3.132	0,01	40.780	Marel	135.390	0,30
216	Genmab	77.103	0,17		Indonésie		
962	Novo Nordisk	164.958	0,36	169.500	Bank Rakyat Indonesia Persero	56.932	0,12
498	Novozymes	19.922	0,04		Irlande		
368	Orsted	21.783	0,05	1.475	Bank of Ireland	13.538	0,03
88	ROCKWOOL	20.855	0,05	113	CRH	6.016	0,01
8.738	Vestas Wind Systems	187.193	0,41	1.244	Eaton	265.106	0,58
		494.946	1,09	1.255.884	Greencoat Renewables	1.250.860	2,75
	Finlande			75	Horizon Therapeutics	7.815	0,02
456	Kesko	8.240	0,02	25	Jazz Pharmaceuticals	3.368	0,01
129	Kone	5.476	0,01	2.810	Kerry	242.503	0,53
8.291	Nokia	30.676	0,07	2.308	Kingspan	179.563	0,40
5.992	UPM-Kymmene	190.426	0,42	101	Linde	36.195	0,08
		234.818	0,52	678	Medtronic	51.524	0,11
	France			3.216	Pentair	208.176	0,46
11	Air Liquide	1.852	0,00	3.621	Smurfit Kappa	141.328	0,31
23	Alstom	590	0,00	87	STERIS	18.601	0,04
7.416	Bureau Veritas	184.733	0,41			2.424.593	5,33
138	Carrefour	2.444	0,01		Île de Man		
528	Cie Generale des Etablissements Michelin	15.370	0,04	874.774	Agronomics	98.325	0,22
41	Covivio	1.847	0,01		Israël		
2.401	Dassault Systemes	88.117	0,19	1.980	Teva Pharmaceutical Industries	17.784	0,04
317	Eurazeo	17.387	0,04		Italie		
17	Gecina	1.677	0,00	24.823	Enel*	154.796	0,34
152	Klepierre	3.744	0,01	1.896	Nexi	12.707	0,03
86	Legrand	7.876	0,02	268	Prysmian	10.187	0,02
139	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	110.366	0,24	6.604	Terna - Rete Elettrica Nazionale	50.494	0,11
87	Pernod Ricard	16.012	0,03			228.184	0,50
119	Publicis Groupe	8.644	0,02		Japon		
202	Robertet	172.306	0,38	100	Advantest	11.547	0,03
2.153	Schneider Electric	343.360	0,75	800	Aeon	15.231	0,03
208	Unibail-Rodamco-Westfield	10.304	0,02	300	Asahi	10.738	0,02
1.737	Veolia Environnement	50.043	0,11	200	Azbil	6.130	0,01
264	Vinci	27.361	0,06	400	Central Japan Railway	47.146	0,10
		1.064.033	2,34	7.100	Chiba Bank	46.633	0,10
	Allemagne			3.400	Chugai Pharmaceutical	95.565	0,21
566	Bayerische Motoren Werke	55.253	0,12	13.200	Concordia Financial	53.809	0,12
951	DHL	41.145	0,09	100	Dai Nippon Printing	2.512	0,01
102	HelloFresh	3.015	0,01	500	Daiichi Sankyo	13.556	0,03
4.408	Infineon Technologies	146.169	0,32	600	East Japan Railway	31.148	0,07
360	SAP*	46.793	0,10	1.000	FANUC	26.190	0,06
561	Siemens	78.170	0,17	300	Hitachi	18.340	0,04
134	SMA Solar Technology	10.030	0,03	1.100	KDDI*	30.003	0,07
1.795	Symrise	173.505	0,38	300	Keyence	114.498	0,25
489	Vonovia*	10.870	0,02	1.000	Komatsu	26.171	0,06
163	Zalando	4.735	0,01	1.400	Kubota	20.616	0,04
		569.685	1,25	2.900	Kurita Water Industries	103.933	0,23
	Grèce			400	Kyocera	18.864	0,04
23.924	Piraeus Financial	77.275	0,17	300	Mitsui Fudosan	6.039	0,02
	Hong Kong			1.400	Murata Manufacturing	72.265	0,16
12.000	China Everbright Environment	4.033	0,01	100	NGK Insulators	1.220	0,00
2.000	CSPC Pharmaceutical	1.387	0,00	100	Nidec	4.813	0,01
2.000	Henderson Land Development	5.065	0,01	500	Nippon Yusen	12.253	0,03
				200	Nomura Research Institute	5.279	0,01
				300	Obayashi	2.496	0,01
				200	Omron	8.877	0,02
				1.100	Ono Pharmaceutical	19.157	0,04

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Climate Action Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
900	Renesas Electronics	13.908	0,03	391	Samsung SDI	167.413	0,37
700	Ricoh	5.244	0,01	2.196	Shinhan Financial	54.440	0,12
400	Seiko Epson	5.758	0,01	1	SK IE Technology	63	0,00
1.300	Shionogi	52.608	0,12			639.534	1,40
500	Sony	38.295	0,08				
5.800	Sumitomo Chemical	14.755	0,03		Espagne		
1.000	Sumitomo Forestry	25.894	0,06	180	Acciona	23.796	0,05
100	TOTO	2.519	0,01	430	ACCIONA Energias Renovables	11.808	0,02
200	Toyota Motor	3.172	0,01	114	Aena SME	16.598	0,04
400	West Japan Railway	15.902	0,03	23.848	EDP Renovaveis	404.939	0,89
100	Yokogawa Electric	1.822	0,00	1.456	Iberdrola	16.052	0,03
14.500	Z	40.033	0,09	4.272	Telefonica	16.469	0,04
3.100	ZOZO	56.880	0,12			489.662	1,07
		1.101.819	2,42				
	Jersey				Suède		
2.254	WPP	20.115	0,04	528	Atlas Copco	6.495	0,01
	Malaisie			209	Atlas Copco	2.235	0,01
114.400	Public Bank	96.126	0,21	720	EQT	13.426	0,03
	Mexique			60	H & M Hennes & Mauritz	851	0,00
39.168	America Movil	35.205	0,08	849	Holmen	29.797	0,07
4.117	Cemex	3.170	0,01	171	Husqvarna	1.365	0,00
24.210	Grupo Rotoplas	34.174	0,07	42.987	Orron Energy	32.992	0,07
		72.549	0,16	3.220	Svenska Cellulosa	39.747	0,09
						126.908	0,28
	Pays-Bas				Suisse		
129	Akzo Nobel	9.719	0,02	1.625	ABB	57.150	0,13
103	ASML	63.231	0,14	1.432	DSM-Firmenich*	122.063	0,27
384	Corbion	8.517	0,02	12	Givaudan	37.156	0,08
921	Koninklijke Ahold Delhaize	27.939	0,06	20	Kuehne + Nagel International	5.550	0,01
248	NXP Semiconductors	47.150	0,10	806	Novartis	75.365	0,17
3.877	STMicroelectronics	170.336	0,37	138	Roche	37.754	0,08
		326.892	0,71	47	Roche	13.616	0,03
	Nouvelle-Zélande			776	SGS	64.948	0,14
970	Auckland International Airport	4.153	0,01	9.938	SIG	244.552	0,54
1.656	Fisher & Paykel Healthcare	20.616	0,04	144	Sika	37.719	0,08
3.190	Meridian Energy	9.382	0,02	800	TE Connectivity	98.003	0,22
		34.151	0,07			793.876	1,75
	Norvège				Taiwan		
2.603	Leroy Seafood	9.922	0,02	66.000	Cathay Financial	87.104	0,19
3.913	Mowi	65.265	0,14	8.000	Delta Electronics	80.112	0,18
6.431	NEL*	6.448	0,01	21.629	E.Sun Financial	15.305	0,03
4.276	Orkla	30.038	0,07	47.000	Fubon Financial	86.514	0,19
4.114	Salmar	184.808	0,41	40.638	Taishin Financial	20.936	0,05
2.873	Telenor	28.411	0,06	3.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	47.667	0,10
960	TOMRA Systems	12.223	0,03	19.000	Tatung	27.825	0,06
		337.115	0,74	15.000	United Renewable Energy	7.141	0,02
	Singapour			1.000	Wiwynn	45.150	0,10
700	CapitaLand Investment	1.546	0,00			417.754	0,92
	Afrique du Sud				Thaïlande		
250	Aspen Pharmacare	2.106	0,00	172.000	Charoen Pokphand Foods	93.714	0,21
59.864	Life Healthcare	62.988	0,14	6.500	Delta Electronics Thailand	18.563	0,04
671	Shoprite	8.688	0,02	27.500	Energy Absolute	45.782	0,10
2.074	Vodacom	11.050	0,03	42.300	Thai Union	15.922	0,03
		84.832	0,19			173.981	0,38
	Corée du Sud				Turquie		
1.645	Coway	49.556	0,11	1.740	BIM Birlesik Magazalar	15.317	0,03
1.405	Hana Financial	38.749	0,08		Royaume-Uni		
10.244	Hanon Systems	65.077	0,14	374	AstraZeneca	46.993	0,11
509	Hanwha Solutions	12.938	0,03	12.127	Auto Trader*	86.290	0,19
6.573	Industrial Bank of Korea	49.320	0,11	790	Barratt Developments	4.195	0,01
1.695	KB Financial	63.945	0,14	682	British Land	2.619	0,01
168	LG Chem	68.300	0,15	6.800	BT	9.145	0,02
1.002	LS Electric	69.733	0,15	151	Bunzl	5.025	0,01
				229	Burberry	5.918	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Climate Action Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
398	Compass*	9.355	0,02	209	Cummins	44.672	0,10
115	Croda International	7.468	0,02	281	Danaher	69.026	0,15
1.212	Diageo	46.392	0,10	3.238	Darling Ingredients*	188.022	0,41
754	Halma	18.967	0,04	47	DaVita	4.501	0,01
371	Informa	3.202	0,01	1.476	Deere	563.235	1,24
8.644	ITM Power	8.936	0,02	297	Dell Technologies	15.396	0,03
2.531	JD Sports Fashion*	4.328	0,01	162	Dexcom	15.381	0,03
574	Johnson Matthey	10.965	0,02	225	Digital Realty Trust*	27.298	0,06
7.960	Kingfisher	21.819	0,05	1.449	Dover	198.957	0,44
1.498	Liberty Global	25.467	0,06	1.844	eBay	76.211	0,17
1.620	Liberty Global	29.550	0,07	2.049	Ecolab	349.235	0,77
356	London Stock Exchange	33.975	0,07	1.271	Edwards Lifesciences	90.872	0,20
157	Pearson	1.552	0,00	264	Eli Lilly	133.588	0,29
781	RELX	23.561	0,05	129	Enphase Energy	15.200	0,03
570	Schroders	2.777	0,01	30	Equinix	21.822	0,05
1.220.079	Sdcl Energy Efficiency Income Trust	1.056.326	2,32	243	Estee Lauder	36.980	0,08
765	Segro	6.618	0,01	227	Etsy	15.527	0,03
573	Sensata Technologies	20.032	0,04	1.244	Exelon	46.506	0,10
575	Severn Trent	16.257	0,03	1.319	First Solar	229.274	0,51
937	Spirax-Sarco Engineering	111.286	0,24	2.458	FMC	198.644	0,44
1.854	SSE	35.331	0,08	940	General Mills	58.959	0,13
2.860	United Utilities*	31.558	0,07	458	General Motors	14.159	0,03
21.562	Vodafone	18.552	0,04	329	Global Payments*	38.651	0,09
		1.704.459	3,74	3.390	Graphic Packaging	69.991	0,15
				2.305	Hain Celestial	23.349	0,05
	États-Unis			104	Healthpeak Properties	1.984	0,00
746	A O Smith	50.153	0,11	405	Hershey	80.791	0,18
557	Adobe	286.328	0,63	295	Hilton Worldwide	40.818	0,09
1.253	Advanced Micro Devices	124.036	0,27	1.418	Hologic	99.134	0,22
1.616	AECOM	131.655	0,29	304	Hormel Foods	10.819	0,02
2.380	AGCO	287.501	0,63	83	Host Hotels & Resorts	1.220	0,00
20	Agilent Technologies	2.266	0,00	4.348	HP	117.743	0,26
286	Airbnb	34.672	0,08	108	illumina	16.646	0,04
528	Albemarle	96.772	0,21	1.293	Incyte	77.203	0,17
85	Alexandria Real Estate Equities	9.194	0,02	3.259	Ingersoll Rand	209.968	0,46
24	Alnylam Pharmaceuticals	4.413	0,01	39	Insulet	7.056	0,02
211	American Tower	35.498	0,08	577	International Flavors & Fragrances*	37.776	0,08
220	Amgen	52.111	0,11	359	Intuit	179.023	0,39
1.807	Analog Devices	303.341	0,67	61	Iron Mountain	3.574	0,01
439	ANSYS	128.470	0,28	119	J M Smucker	15.733	0,03
7.703	Apple	1.335.207	2,93	80	Jack Henry & Associates	11.743	0,03
1.607	Archer-Daniels-Midland	118.983	0,26	2.107	John Bean Technologies	213.624	0,47
11.534	AT&T	157.444	0,35	644	Kellogg	36.315	0,08
1.137	Autodesk	233.029	0,51	2.153	Keurig Dr Pepper	67.094	0,15
119	AvalonBay Communities	20.246	0,04	255	Kimberly-Clark	30.489	0,07
953	Avery Dennison	166.015	0,36	1.161	Kraft Heinz	35.474	0,08
263	Badger Meter	40.482	0,09	126	Lam Research	80.722	0,18
450	Ball	22.555	0,05	134	Lennox International	46.407	0,10
323	Baxter International	12.325	0,03	199	LKQ	9.842	0,02
344	Best Buy	24.046	0,05	405	Lucid	2.382	0,01
90	Biogen	22.106	0,05	54	Lululemon Athletica	18.983	0,04
4	BioMarin Pharmaceutical	348	0,00	497	Masco	27.192	0,06
439	Block	23.469	0,05	527	MasTec	48.316	0,11
954	Bloom Energy	13.568	0,03	1.027	Mastercard	392.343	0,86
368	Boston Properties	22.821	0,05	340	McCormick	26.017	0,06
1.319	Boston Scientific	66.209	0,15	23	MercadoLibre	28.661	0,06
221	Cadence Design Systems	49.185	0,11	1.358	Merck	137.572	0,30
662	Campbell Soup*	25.853	0,06	21	Mettler-Toledo International	23.704	0,05
61	CF Industries	4.323	0,01	3.681	Microsoft	1.116.434	2,45
14	Charles River Laboratories International	2.712	0,01	648	Molson Coors Beverage	37.783	0,08
217	Church & Dwight	19.229	0,04	281	Moody's	87.477	0,19
6.058	Cisco Systems	319.862	0,70	109	MSCI	54.772	0,12
144	Clorox	20.738	0,05	1.055	Nasdaq	51.508	0,11
1.702	Cognizant Technology Solutions	112.463	0,25	272	Netflix	109.182	0,24
1.047	Conagra Brands	29.153	0,06	407	Newmont	14.964	0,03
1.474	Corcept Therapeutics	44.643	0,10	4.081	NextEra Energy	254.013	0,56
2.161	Crown	185.118	0,41	347	Nucor	54.835	0,12
				1.063	NVIDIA	487.133	1,07
				253	Okta	19.765	0,04

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Climate Action Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
51	ON Semiconductor	4.663	0,01	CAD 182.000	National Bank of Canada		
840	Ormat Technologies	58.718	0,13		1,534% 15/6/2026	111.751	0,24
191	Owens Corning	25.180	0,06			965.400	2,11
455	Palo Alto Networks	101.363	0,22				
1.239	PayPal	72.220	0,16				
2.249	Pfizer	74.418	0,16	USD 442.000	International Asian Development Bank		
494	Prologis	57.038	0,13		1,75% 14/8/2026	375.482	0,82
581	Quanta Services	113.421	0,25	USD 137.000	Asian Development Bank		
210	Regeneron Pharmaceuticals	160.785	0,35		2,125% 19/3/2025	120.596	0,26
2.606	Republic Services	350.110	0,77	USD 496.000	Asian Development Bank		
63	ResMed	9.523	0,02		3,125% 26/9/2028	430.757	0,95
451	Rivian Automotive*	9.623	0,02	EUR 130.000	European Investment Bank		
586	Rogers	77.804	0,17		0,375% 15/5/2026	120.842	0,27
297	S&P Global	107.654	0,24	USD 165.000	European Investment Bank		
1.011	Salesforce	211.193	0,46		0,625% 21/10/2027	130.559	0,29
62	SBA Communications	13.007	0,03	USD 641.000	European Investment Bank		
316	Sealed Air	10.858	0,02		0,75% 23/9/2030	466.222	1,02
329	ServiceNow	179.725	0,39	USD 336.000	European Investment Bank		
281	Sherwin-Williams	70.386	0,16		0,875% 17/5/2030	248.905	0,55
64	Simon Property	6.688	0,01	USD 586.000	European Investment Bank		
3.704	Snap	35.011	0,08		1,625% 9/10/2029	464.943	1,02
20	SolarEdge Technologies	3.033	0,01	USD 329.000	European Investment Bank		
177	Splunk	19.841	0,04		2,875% 13/6/2025	292.126	0,64
277	Stanley Black & Decker	24.462	0,05	USD 342.000	International Bank for Reconstruction & Development 2,125%		
470	Steel Dynamics	46.158	0,10		3/3/2025	301.447	0,66
281	Stryker	74.862	0,16	USD 384.000	International Finance 2,125%		
890	SunPower	5.939	0,01		7/4/2026	331.849	0,73
691	Sunrun*	10.044	0,02			3.283.728	7,21
405	Target	47.024	0,10				
51	Teleflex	10.221	0,02				
1.196	Tesla	283.560	0,62				
1.315	Texas Instruments	205.332	0,45	EUR 172.000	Italie Assicurazioni Generali 1,713%		
146	Thermo Fisher Scientific	75.621	0,17		30/6/2032	131.455	0,29
858	TJX	73.246	0,16				
3.466	Trimble	174.331	0,38	USD 8	Luxembourg Ensemble Investment 0%		
736	Union Pacific	150.945	0,33		11/8/2028	73.264	0,16
208	United Therapeutics	43.772	0,10				
19	Veeva Systems	3.585	0,01	NZD 210.000	Nouvelle-Zélande Housing New Zealand 2,247%		
309	Ventas	12.514	0,03		5/10/2026	105.375	0,23
7.291	Verizon Communications	234.265	0,51				
117	Vertex Pharmaceuticals	37.481	0,08	USD 200.000	Arabie Saoudite Arab Petroleum Investments		
495	VF	8.915	0,02		1,483% 6/10/2026	164.732	0,36
3.411	Viatis	34.505	0,08				
1.926	Visa*	438.422	0,96	EUR 367.000	Slovénie Slovenia Government Bond		
960	VMware	149.776	0,33		0,125% 1/7/2031	285.900	0,63
1.648	Waste Management	240.301	0,53				
398	Welltower	30.550	0,07	USD 555.000	Corée du Sud Kookmin Bank 2,5% 4/11/2030	414.711	0,91
839	Western Digital	35.132	0,08	USD 200.000	Kookmin Bank 4,35% 2/7/2024	179.872	0,40
1.337	Westrock	40.235	0,09			594.583	1,31
498	Workday	112.264	0,25				
4.137	Xylem	396.867	0,87				
663	Yum China	32.889	0,07				
619	Yum! Brands	74.421	0,17				
115	Zebra Technologies	29.541	0,07				
276	Zimmer Biomet	30.636	0,07				
265	Zoetis*	47.143	0,10				
		16.595.453	36,44				
	Total des actions ordinaires et privilégiées	31.639.614	69,47				
	OBLIGATIONS						
	Autriche						
EUR 200.000	Erste Bank 0,125% 17/5/2028	168.359	0,37				
	Canada						
USD 154.000	Bank of Nova Scotia/The 0,65% 31/7/2024	135.534	0,30				
USD 590.000	CDP Financial 1% 26/5/2026	490.227	1,07				
USD 250.000	National Bank of Canada 0,55% 15/11/2024	227.888	0,50				
	Royaume-Uni						
GBP 321.000	Paragon Treasury 2% 7/5/2036	244.563	0,54				
	Total des obligations	6.512.182	14,30				
	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	43.764.421	96,09				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Climate Action Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Autres titres négociables			
ACTIONS ORDINAIRES			
Pays-Bas			
134	DSM BV**	12.257	0,03
États-Unis			
7	Contra Abiomed**	18	0,00
Total des actions ordinaires		12.275	0,03
DROITS			
France			
1.613	Fermentalg (31/12/2049)**	-	0,00
Total Droits		-	0,00
Total des autres valeurs mobilières		12.275	0,03
Total du portefeuille		43.776.696	96,13
Autres éléments de l'actif net		1.763.828	3,87
Total de l'actif net (EUR)		45.540.524	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
EUR	3.445.468	GBP	2.958.000	BNP Paribas	18/10/2023	(3.691)
EUR	4.725.870	USD	5.304.000	Standard Chartered Bank	18/10/2023	(152.286)
INR	212.200.000	USD	2.539.880	HSBC Bank	18/7/2024	(10.654)
JPY	65.000.000	EUR	424.147	BNP Paribas	18/10/2023	(12.176)
JPY	206.110.000	USD	1.508.805	Morgan Stanley	18/10/2023	(81.340)
USD	2.260.550	TWD	70.337.000	Goldman Sachs	18/10/2023	44.579
USD	1.521.940	GBP	1.165.000	BNP Paribas	18/10/2023	41.306
USD	293.208	TWD	9.200.000	UBS	18/10/2023	3.560
USD	1.427.251	JPY	206.110.000	Morgan Stanley	18/10/2023	6.334
Moins-value nette non réalisée						(164.368)
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	122	USD	133	BNY Mellon	15/9/2023	-
USD	5.032	EUR	4.587	BNY Mellon	15/9/2023	48
Plus-value nette non réalisée						48
Total des moins-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 26.189.034)						(164.320)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
12	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	1.596.000	(14.280)
(9)	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	1.043.190	(3.510)
41	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	4.190.549	32.194
Total				6.829.739	14.404

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Climate Action Multi-Asset Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
2.000.000	Call	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 136	1/3/2033	12.949	30.574
928.108	Put	S&P 500 Index	BNP Paribas	USD 125	15/12/2023	(9.614)	128
5	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.400	15/12/2023	(18.359)	32.720
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 872.690)						(15.024)	63.422

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
(5)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3.950	15/12/2023	9.945	(10.116)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 192.392)						9.945	(10.116)

Continental European Flexible Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				1.774.425	BE Semiconductor Industries*	190.573.245	3,58
				476.185	Ferrari	140.760.286	2,65
				792.126	IMCD*	101.352.522	1,91
				4.827.873	STMicroelectronics	212.112.600	3,99
						1.168.524.458	21,97
ACTIONS ORDINAIRES							
Belgique				Espagne			
1.856.861	Azelis	37.582.867	0,71	19.564.767	CaixaBank*	73.993.949	1,39
Danemark				Suède			
1.168.134	DSV*	203.549.524	3,82	3.624.936	Atlas Copco	44.592.246	0,84
3.003.748	Novo Nordisk	515.064.778	9,68	3.668.283	Epiroc*	65.270.784	1,22
929.897	Pandora	88.848.544	1,67	2.414.226	EQT*	45.017.139	0,85
						154.880.169	2,91
France				Suisse			
1.924.573	BNP Paribas	115.570.609	2,17	401.949	Bachem*	34.648.119	0,65
2.247.998	Cie de Saint-Gobain	134.947.320	2,54	607.232	Cie Financiere Richemont	79.814.442	1,50
88.737	Hermes International	170.144.324	3,20	434.951	Lonza*	223.141.766	4,20
523.970	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	416.032.180	7,82	335.921	Nestle	37.419.072	0,70
162.605	Sartorius Stedim Biotech	42.700.073	0,80	457.716	Sika*	119.894.283	2,25
731.407	Schneider Electric	116.644.788	2,19	546.649	Straumann*	76.728.993	1,44
5.863.596	Societe Generale*	154.476.436	2,90			571.646.675	10,74
						1.150.515.730	21,62
Allemagne				Royaume-Uni			
14.188.566	Commerzbank	144.794.316	2,72	1.307.083	Allfunds	7.156.279	0,13
589.496	CTS Eventim*	33.896.020	0,64	1.715.380	Ashtead	111.476.385	2,10
85.360	Hypoport	14.588.024	0,27			118.632.664	2,23
493.993	MTU Aero Engines*	107.196.481	2,01	Total des actions ordinaires			
29.475	Rational*	20.765.138	0,39			5.171.828.940	97,19
884.262	Siemens	123.213.067	2,32	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
						5.171.828.940	97,19
Irlande				Autres titres négociables			
14.646.853	AIB	61.604.664	1,16	ACTIONS ORDINAIRES			
13.590.723	Bank of Ireland	124.735.655	2,34	Danemark			
326.395	Kingspan	25.393.531	0,48	997.833	Coloplast**	101.097.470	1,90
703.066	Linde	251.956.583	4,73	Total des actions ordinaires			
						101.097.470	1,90
Italie				Total des autres valeurs mobilières			
7.929.954	UniCredit*	180.446.103	3,39			101.097.470	1,90
Pays-Bas				Total du portefeuille			
27.398	Adyen	21.345.782	0,40			5.272.926.410	99,09
348.620	ASM International*	156.565.242	2,94	Autres éléments de l'actif net			
563.308	ASML	345.814.781	6,50			48.273.796	0,91
						5.321.200.206	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Continental European Flexible Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	20.680.529	GBP	17.748.139	BNY Mellon	15/9/2023	(46.417)
GBP	257.985.880	EUR	299.230.832	BNY Mellon	15/9/2023	2.055.445
Plus-value nette non réalisée						2.009.028
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	45.268.553	USD	49.317.144	BNY Mellon	15/9/2023	(163.217)
USD	589.807.210	EUR	537.716.024	BNY Mellon	15/9/2023	5.626.085
Plus-value nette non réalisée						5.462.868
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 911.265.819)						7.471.896

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Moins-value non réalisée EUR
Irlande			
1.168.114	Bank of Ireland	HSBC Bank	(471.918)
1.500.971	Bank of Ireland	JP Morgan	(606.392)
			(1.078.310)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 24.496.862)			(1.078.310)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation cyclique	20,49
Biens de consommation non cyclique	20,37
Valeurs industrielles	17,67
Technologie	17,01
Finance	16,92
Matériaux de base	4,73
Soins de santé	1,90
Autres éléments de l'actif net	0,91
<hr/>	
	100,00

Developed Markets Sustainable Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Danemark				Royaume-Uni			
1.721	Novo Nordisk	320.175	1,85	4.039	AstraZeneca	550.609	3,18
				19.989	RELX	654.254	3,78
				71.556	Rentokil Initial	547.876	3,17
						1.752.739	10,13
France				États-Unis			
7.377	BNP Paribas*	480.619	2,78	6.431	Alphabet	879.375	5,08
2.939	Schneider Electric	508.526	2,94	3.276	American Express	524.913	3,03
				2.579	Analog Devices	469.713	2,72
				1.118	Cadence Design Systems	269.952	1,56
				8.274	Colgate-Palmolive	611.531	3,54
				8.773	eBay	393.381	2,28
				1.231	Elevance Health	562.075	3,25
				4.969	Intercontinental Exchange	586.292	3,39
				1.050	Intuit	568.082	3,28
				2.047	Mastercard	848.441	4,90
				4.261	Microsoft	1.402.125	8,10
				6.829	Otis Worldwide	591.186	3,41
				3.356	Republic Services	489.171	2,83
				1.065	Thermo Fisher Scientific	598.477	3,46
				2.401	Verisk Analytics	581.954	3,36
				4.903	Walt Disney	413.862	2,39
						9.790.530	56,58
						17.153.173	99,12
				Total des actions ordinaires			
						17.153.173	99,12
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
						17.153.173	99,13
				Total du portefeuille			
						17.153.173	99,13
				Autres éléments de l'actif net			
						151.290	0,87
				Total de l'actif net (USD)			
						17.304.463	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Developed Markets Sustainable Equity Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Moins-value non réalisée USD
USD	577.332	GBP	457.007	Deutsche Bank	15/9/2023	(2.022)
Moins-value nette non réalisée						(2.022)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 579.296)						(2.022)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	37,23
Technologie	19,29
Finance	14,10
Communications	9,75
Valeurs industrielles	9,18
Matériaux de base	5,14
Biens de consommation cyclique	4,44
Autres éléments de l'actif net	0,87
	100,00

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Inde				Pologne			
206.050	Axis Bank	2.422.983	0,09	232.812	Powszechna Kasa		
122.559	Godrej Consumer Products	1.488.051	0,05	34.957	Oszczednosci Bank Polski	2.116.124	0,08
171.170	HDFC Bank	3.249.151	0,11		Powszechny Zaklad Ubezpieczen	351.855	0,01
95.740	Infosys*	1.670.663	0,06			2.467.979	0,09
56.759	InterGlobe Aviation	1.669.458	0,06	Arabie Saoudite			
17.796	Maruti Suzuki India	2.150.449	0,07	63.620	Saudi Basic Industries	1.499.479	0,05
130.350	SBI Cards & Payment Services	1.285.688	0,05	Singapour			
53.711	Tata Consultancy Services	2.177.863	0,08	229.700	BOC Aviation	1.723.560	0,06
		16.114.306	0,57	1.144.020	Cromwell European Real Estate Investment Trust	1.762.503	0,06
Indonésie				98.900	DBS	2.436.440	0,09
4.372.100	Astra International	1.851.612	0,06			5.922.503	0,21
11.430.550	Bank Rakyat Indonesia Persero	4.165.433	0,15	Afrique du Sud			
		6.017.045	0,21	153.815	Absa	1.506.101	0,05
Irlande				22.115	Gold Fields*	285.063	0,01
20.944	Accenture	6.813.502	0,24	59.216	Gold Fields	766.467	0,03
2.856	Allegion	325.984	0,01	527.251	Truworths International	1.994.798	0,07
101.036	Medtronic	8.330.418	0,30			4.552.429	0,16
8.895	Willis Towers Watson	1.857.543	0,07	Corée du Sud			
		17.327.447	0,62	984.841	ESR Kendall Square REIT	2.924.533	0,10
Italie				7.772	Hansol Chemical	949.633	0,03
111.535	Terna - Rete Elettrica Nazionale	925.238	0,03	14.465	Samsung Electronics	732.142	0,03
Japon				3.625	Samsung Electronics	4.585.625	0,16
331.900	Hulic	2.970.308	0,11	147.849	Samsung Electronics	6.040.360	0,21
6.700	Japan Airport Terminal*	316.629	0,01	1.967	Samsung SDI	913.742	0,03
177.400	Komatsu	5.037.187	0,18	28.242	S-Oil	1.559.800	0,06
22.680	Sony*	1.886.522	0,07			17.705.835	0,62
27.700	Tokyo Gas	640.026	0,02	Espagne			
8.200	West Japan Railway*	353.685	0,01	15.016	Aena SME	2.372.048	0,08
		11.204.357	0,40	125.114	Cellnex Telecom	4.824.265	0,17
Jersey						7.196.313	0,25
7.156	Amcor	70.164	0,00	Suisse			
20.128	Ferguson*	3.297.847	0,12	7.681	Flughafen Zurich	1.594.974	0,06
		3.368.011	0,12	6.954	Lonza	3.870.642	0,14
Kazakhstan				54.130	Nestle	6.541.867	0,23
22.080	Kaspi.KZ JSC	2.296.320	0,08	24.198	TE Connectivity	3.216.156	0,11
Luxembourg				9.237	Zurich Insurance	4.356.991	0,15
53.643	SES*	392.266	0,01			19.580.630	0,69
Mexique				Taiwan			
1.155.700	Fibra Uno Administracion	1.774.070	0,06	144.000	Accton Technology	2.161.366	0,08
101.940	Grupo Aeroportuario del Pacifico	1.970.518	0,07	127.000	Delta Electronics	1.379.805	0,05
361.196	Grupo Financiero Banorte	3.195.308	0,11	55.000	Lotes	1.493.884	0,05
40.872	Inmobiliaria Vesta	1.559.267	0,06	171.000	MediaTek	3.785.499	0,13
1.055.585	Wal-Mart de Mexico	4.309.889	0,15	886.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	15.273.690	0,54
		12.809.052	0,45	15.964	Taiwan Semiconductor Manufacturing	1.498.541	0,05
Pays-Bas						25.592.785	0,90
16.423	Airbus*	2.424.325	0,09	Thaïlande			
1.303.423	Koninklijke KPN	4.569.095	0,16	1.011.100	CP ALL	1.884.037	0,07
77.973	Koninklijke Philips*	1.763.835	0,07	Émirats arabes unis			
9.507	Koninklijke Vopak	342.341	0,01	466.798	Abu Dhabi Commercial Bank	1.096.761	0,04
32.292	Prosus	2.257.308	0,08	440.440	Salik	401.702	0,01
		11.356.904	0,41			1.498.463	0,05
Nouvelle-Zélande							
177.626	Auckland International Airport	825.072	0,03				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Royaume-Uni				18.882	Dollar General	2.476.186	0,09
9.827.977	Assura*	5.723.405	0,20	4.641	Dominion Energy	228.662	0,01
59.882	AstraZeneca	8.163.299	0,29	974	Domino's Pizza	381.282	0,01
540.910	BAE Systems	6.937.777	0,25	12.779	DT Midstream*	670.770	0,02
749.873	BP	4.662.103	0,16	13.556	DTE Energy	1.423.651	0,05
112.072	British American Tobacco	3.760.542	0,13	30.212	Duke Energy	2.721.799	0,10
1.078.163	LondonMetric Property	2.475.154	0,09	247.740	Dun & Bradstreet	2.702.843	0,09
2.330.989	LXI REIT	2.767.243	0,10	12.360	Edison International	867.177	0,03
185.257	National Grid	2.342.774	0,08	5.612	Elevance Health	2.562.439	0,09
539.955	Prudential	6.735.717	0,24	2.122	Eli Lilly	1.164.978	0,04
12.041	Reckitt Benckiser*	877.056	0,03	19.404	Entergy	1.880.248	0,06
144.794	RELX	4.745.796	0,17	95.291	EPR Properties*	4.261.414	0,15
303.493	Shell*	9.368.671	0,33	4.074	Equinix	3.215.119	0,11
23.919	SSE	494.534	0,02	62.542	Equitable	1.830.605	0,07
3.237.967	Target Healthcare REIT	2.970.440	0,10	20.461	Eversource Energy	1.321.576	0,04
2.946.661	Taylor Wimpey	4.299.371	0,15	88.485	Exelon	3.588.952	0,12
37.832	Unilever*	1.952.888	0,07	7.544	Exxon Mobil	836.177	0,03
47.948	United Utilities	574.019	0,02	1.497	FactSet Research Systems	652.033	0,02
2.600.007	Vodafone	2.427.100	0,08	11.201	Fastenal	650.330	0,02
		71.277.889	2,51	91.090	Fidelity National Financial	3.748.353	0,13
				66.386	Fidelity National Information Services	3.738.196	0,13
États-Unis				2.452	First Citizens BancShares	3.342.811	0,12
35.610	AbbVie	5.292.002	0,19	21.733	Fortrea	595.701	0,02
5.477	Advance Auto Parts	375.338	0,01	46.195	Fox	1.545.685	0,06
5.085	Agilent Technologies	625.049	0,02	72.190	General Motors	2.421.253	0,08
59.706	Alexandria Real Estate Equities	7.006.499	0,25	5.493	Globe Life	619.720	0,02
30.721	Alliant Energy	1.560.933	0,06	16.119	Halliburton	626.706	0,02
95.000	Allstate	1.913.300	0,07	2.142	HCA Healthcare	599.503	0,02
4.568	Alphabet	629.607	0,02	169.413	Healthpeak Properties	3.506.002	0,12
11.869	Ameren	955.811	0,03	2.681	Home Depot	889.717	0,03
39.271	American Electric Power	3.124.794	0,11	30.360	HP	891.977	0,03
20.889	American Express	3.347.045	0,12	2.205	Humana	1.040.209	0,04
55.891	American International	3.265.712	0,11	18.042	Huntington Ingalls Industries	3.998.648	0,14
36.986	American Tower	6.751.055	0,24	25.533	Intel	880.889	0,03
7.299	Amphenol	646.984	0,02	48.432	Intercontinental Exchange	5.714.492	0,20
40.967	Apple	7.704.254	0,27	34.080	International Flavors & Fragrances	2.420.703	0,09
23.053	Assurant	3.205.059	0,11	2.985	Jack Henry & Associates	475.391	0,02
98.199	AT&T	1.454.327	0,05	254.047	Kosmos Energy	1.864.705	0,07
3.369	Avery Dennison	636.741	0,02	129.205	Kraft Heinz	4.283.146	0,15
132.866	Baker Hughes	4.799.785	0,17	15.303	Laboratory of America	3.254.335	0,12
10.303	Ball	560.277	0,02	16.474	Lear	2.406.522	0,08
103.856	Baxter International	4.299.638	0,15	47.553	Leidos	4.689.677	0,17
3.637	Best Buy	275.830	0,01	24.364	M&T Bank	3.062.312	0,11
55.834	Boston Properties*	3.756.511	0,13	1.563	McKesson	655.054	0,02
1.589	Brown & Brown	118.429	0,00	1.837	Meta Platforms	548.638	0,02
5.629	Capital One Financial	581.307	0,02	44.725	Microsoft	14.717.208	0,52
38.333	Cardinal Health	3.387.104	0,12	664	Mid-America Apartment Communities	96.871	0,00
90.016	Carlyle	2.918.319	0,10	88.913	Mondelez International	6.333.273	0,22
74.870	Carrier Global	4.320.748	0,15	408	Monolithic Power Systems	212.551	0,01
151	CDW	31.754	0,00	7.550	MSC Industrial Direct*	770.326	0,03
3.246	Cencora	576.912	0,02	1.194	MSCI	650.944	0,02
7.335	CenterPoint Energy	205.967	0,01	148.755	Newell Brands	1.567.134	0,06
8.137	Cheniere Energy	1.339.187	0,05	38.233	NextEra Energy	2.581.875	0,08
11.076	Cigna	3.115.125	0,11	60.374	NiSource	1.623.457	0,06
952	Cintas	481.731	0,02	5.383	Norfolk Southern	1.117.026	0,04
66.695	Cisco Systems	3.820.623	0,14	147.057	Omega Healthcare Investors*	4.705.824	0,17
110.830	Citigroup	4.602.770	0,16	46.161	Oracle	5.580.865	0,20
155.939	Citizens Financial	4.391.242	0,15	57.554	Otis Worldwide	4.982.450	0,18
32.622	CMS Energy	1.854.887	0,07	2.677	Packaging of America	399.114	0,01
61.214	Cognizant Technology Solutions	4.388.432	0,15	48.144	Paychex	5.882.716	0,20
79.660	Comcast	3.764.732	0,14	116.978	PG&E	1.932.476	0,07
22.384	Community Healthcare Trust	750.759	0,03	55.938	Philip Morris International	5.446.124	0,19
11.098	ConocoPhillips	1.318.775	0,05	337.257	Physicians Realty Trust*	4.708.107	0,17
1.461	Costco Wholesale	794.930	0,03	16.500	Portland General Electric*	733.425	0,03
37.564	Crown Castle	3.801.101	0,13	58.712	Prologis	7.354.852	0,26
35.315	CSX	1.074.283	0,04	11.449	Public Service Enterprise	708.922	0,03
20.687	Digital Realty Trust*	2.723.030	0,10				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 755.000	Husky III 13% 15/2/2025	753.113	0,03	USD 1.000.000	Apidos CLO XXIX 7,513% 25/7/2030	979.665	0,03
USD 1.288.000	Jones Deslauriers Insurance Management 8,5% 15/3/2030	1.316.001	0,05	USD 1.000.000	Apidos CLO XXXVII 6,737% 22/10/2034	993.750	0,04
USD 815.000	Jones Deslauriers Insurance Management 10,5% 15/12/2030	830.482	0,03	USD 750.000	Ares XLIX CLO 7,257% 22/7/2030	742.138	0,03
USD 607.000	Mattamy 4,625% 1/3/2030	535.963	0,02	USD 500.000	Ares XLVIII CLO 7,388% 20/7/2030	487.882	0,02
USD 287.000	Mattamy 5,25% 15/12/2027	270.178	0,01	USD 1.800.000	Ares XXXVIII CLO 7,338% 20/4/2030	1.770.746	0,06
USD 1.641.000	New Gold 7,5% 15/7/2027	1.567.109	0,06	USD 1.500.000	Atrium XIV 7,52% 23/8/2030	1.485.396	0,05
USD 422.000	Ontario Gaming GTA 8% 1/8/2030	427.161	0,02	USD 500.000	Atrium XV 7,357% 23/1/2031	497.634	0,02
USD 31.000	Precision Drilling 6,875% 15/1/2029	29.499	0,00	USD 1.750.000	Bain Capital Credit CLO 2019-2 7,67% 17/10/2032	1.717.110	0,06
USD 161.000	Tervita 11% 1/12/2025	168.396	0,00	USD 1.000.000	Bain Capital Credit CLO 2020-5 7,938% 20/1/2032	1.001.403	0,04
USD 3.088.000	Titan Acquisition / Titan Co-Borrower 7,75% 15/4/2026*	3.000.433	0,11	USD 2.500.000	Bain Capital Credit CLO 2021-6 7,245% 21/10/2034	2.450.532	0,09
USD 272.000	TransAlta 7,75% 15/11/2029	280.221	0,01	USD 3.500.000	Ballyrock CLO 2020-2 8,538% 20/10/2031	3.510.759	0,12
USD 517.000	Vermilion Energy 6,875% 1/5/2030	492.796	0,02	USD 3.000.000	Bardot CLO 8,607% 22/10/2032	2.938.441	0,10
		32.435.844	1,15	USD 2.500.000	Beechwood Park CLO 11,808% 17/1/2035	2.434.394	0,09
Îles Caïmans				USD 1.000.000	Benefit Street Partners CLO XI 7,97% 15/4/2029	1.000.188	0,04
USD 484.185	ABRA Global Finance 11,5% 2/3/2028*	408.609	0,01	USD 1.000.000	Betony CLO 2 7,231% 30/4/2031	989.765	0,04
USD 1.000.000	AGL CLO 11 7,62% 15/4/2034	996.847	0,04	USD 5.000.000	BSL CLO 4 6,957% 20/4/2036	5.038.253	0,18
USD 500.000	AGL CLO 11 8,72% 15/4/2034	493.281	0,02	USD 1.000.000	Canyon Capital CLO 2016-1 7,47% 15/7/2031	977.728	0,03
USD 1.000.000	AGL CLO 12 8,438% 20/7/2034	975.603	0,03	USD 2.000.000	Canyon Capital CLO 2022-1 7,51% 15/4/2035	1.922.258	0,07
USD 1.500.000	AGL CLO 17 7,434% 21/1/2035	1.475.009	0,05	USD 1.000.000	Canyon Capital CLO 2022-1 8,51% 15/4/2035	972.830	0,03
USD 1.000.000	AGL CLO 17 8,434% 21/1/2035	983.622	0,04	USD 1.000.000	Canyon CLO 2020-1 8,72% 15/7/2034	970.669	0,03
USD 1.000.000	AGL CLO 17 11,684% 21/1/2035	964.984	0,03	USD 750.000	Carbone CLO 7,388% 20/1/2031	734.309	0,03
USD 1.000.000	AGL CLO 9 8,088% 20/1/2034	1.009.362	0,04	USD 1.000.000	Carlyle C17 CLO 7,481% 30/4/2031	978.018	0,03
USD 3.380.000	Aimco CLO 11 7,57% 17/10/2034	3.354.499	0,12	USD 750.000	Carlyle US CLO 2017-2 7,988% 20/7/2031	751.052	0,03
USD 1.750.000	Aimco CLO 12 7,358% 17/1/2032	1.722.052	0,06	USD 1.000.000	CarVal CLO I 8,46% 16/7/2031	974.904	0,03
USD 1.000.000	Aimco CLO 12 8,208% 17/1/2032	996.117	0,04	USD 1.000.000	Cedar Funding IX CLO 7,338% 20/4/2031	981.521	0,03
USD 2.500.000	Aimco CLO 15 8,47% 17/10/2034	2.428.295	0,09	USD 1.000.000	Cedar Funding IX CLO 8,188% 20/4/2031	977.954	0,03
USD 500.000	AIMCO CLO Series 2018-A 7,32% 17/4/2031	491.828	0,02	USD 1.000.000	Chenango Park CLO 7,42% 15/4/2030	969.616	0,03
USD 1.000.000	AIMCO CLO Series 2018-A 8,12% 17/4/2031	982.135	0,03	USD 500.000	CIFC Funding 2013-IV 8,419% 27/4/2031	489.428	0,02
USD 515.000	Alinea CLO 2018-1 7,488% 20/7/2031	506.969	0,02	USD 1.000.000	CIFC Funding 2015-I 7,507% 22/1/2031	984.343	0,04
USD 1.000.000	Allegany Park CLO 7,376% 20/1/2035	972.553	0,03	USD 1.000.000	CIFC Funding 2018-V 7,72% 15/1/2032	1.001.434	0,04
USD 1.000.000	Allegany Park CLO 8,426% 20/1/2035	954.465	0,03	USD 800.000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	796.746	0,03
USD 1.000.000	Allegany Park CLO 11,726% 20/1/2035	948.622	0,03	USD 3.500.000	Dryden 41 Senior Loan Fund 8,17% 15/4/2031	3.257.662	0,12
USD 1.000.000	Allegro CLO VIII 7,72% 15/7/2031	995.028	0,04	USD 1.000.000	Dryden 65 CLO 7,672% 18/7/2030	959.770	0,03
USD 2.000.000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 7,363% 13/4/2031	1.962.678	0,07	USD 500.000	Dryden 65 CLO 8,672% 18/7/2030	479.738	0,02
USD 1.000.000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 11,063% 13/4/2031	927.383	0,03	USD 450.000	Eaton Vance CLO 2014-1R 8,62% 15/7/2030	435.017	0,02
USD 800.000	Anchorage Capital CLO 4-R 7,477% 28/1/2031	781.908	0,03	USD 1.000.000	Eaton Vance CLO 2015-1 7,488% 20/1/2030	975.610	0,03
USD 1.000.000	Annisa CLO 2016-2 8,588% 20/7/2031	981.343	0,03				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 500.000	Eaton Vance CLO 2018-1 7,77% 15/10/2030	491.701	0,02	USD 3.000.000	Invesco CLO 2022-1 7,476% 20/4/2035	2.894.232	0,10
USD 570.000	Fantasia 7,95% 5/7/2022***	27.326	0,00	USD 1.000.000	Invesco CLO 2022-1 8,376% 20/4/2035	969.812	0,03
USD 800.000	Fantasia 9,25% 28/7/2023***	40.000	0,00	USD 1.500.000	Invesco CLO 2022-1 11,626% 20/4/2035	1.402.294	0,05
USD 2.336.000	Fantasia 11,75% 17/4/2022***	116.800	0,01	USD 1.000.000	KKR CLO 23 7,838% 20/10/2031	992.174	0,04
USD 600.000	Fantasia 11,875% 1/6/2023***	30.000	0,00	USD 500.000	LCM XXV 7,238% 20/7/2030	494.806	0,02
USD 450.000	Fantasia 12,25% 18/10/2022***	22.500	0,00	USD 776.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10,875% 15/1/2031	780.695	0,03
USD 200.000	Fantasia 15% 18/12/2021***	10.899	0,00	USD 1.000.000	Madison Park Funding XIII 7,482% 19/4/2030	994.530	0,04
USD 3.000.000	Galaxy XV CLO 8,57% 15/10/2030	2.888.009	0,10	USD 750.000	Madison Park Funding XXXI 7,307% 23/1/2031	743.063	0,03
USD 1.000.000	Galaxy XX CLO 7,338% 20/4/2031	983.333	0,03	USD 800.000	Madison Park Funding XXXI 7,757% 23/1/2031	800.910	0,03
USD 4.000.000	Galaxy XX CLO 8,188% 20/4/2031	3.896.457	0,14	USD 400.000	MAF Global 6,375% 20/3/2026	389.326	0,01
USD 1.000.000	Galaxy XXII CLO 7,27% 16/4/2034	980.798	0,03	USD 920.000	MAF Sukuk 4,638% 14/5/2029*	896.439	0,03
USD 1.000.000	Galaxy XXII CLO 8,92% 16/4/2034	965.300	0,03	USD 300.000	Melco Resorts Finance 4,875% 6/6/2025	284.905	0,01
USD 1.000.000	Generate CLO 2 7,457% 22/1/2031	982.397	0,03	USD 1.400.000	Melco Resorts Finance 5,375% 4/12/2029	1.172.514	0,04
USD 2.000.000	Generate CLO 2 9,188% 20/10/2029	1.991.197	0,07	USD 400.000	Melco Resorts Finance 5,75% 21/7/2028*	354.842	0,01
USD 2.000.000	Generate CLO 5 8,957% 22/10/2031	1.996.535	0,07	USD 200.000	MGM China 4,75% 1/2/2027	180.818	0,01
USD 750.000	Gilbert Park CLO 8,52% 15/10/2030	722.552	0,03	USD 200.000	MGM China 5,875% 15/5/2026	191.477	0,01
USD 921.348	Global Aircraft Leasing 6,5% 15/9/2024	864.781	0,03	USD 1.150.000	Neuberger Berman CLO XXII 7,22% 17/10/2030	1.144.598	0,04
USD 4.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 7,388% 20/4/2034	3.919.884	0,14	USD 700.000	Neuberger Berman CLO XXII 7,77% 17/10/2030	696.866	0,02
USD 1.400.000	Goldentree Loan Management US CLO 10 8,638% 20/7/2034	1.363.559	0,05	USD 1.850.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 25 8,422% 18/10/2029	1.816.068	0,06
USD 1.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 3 7,488% 20/4/2030	980.195	0,03	USD 3.500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 8,222% 18/10/2030	3.410.244	0,12
USD 1.500.000	Goldentree Loan Management US CLO 3 8,438% 20/4/2030	1.487.580	0,05	USD 1.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 27 8,17% 15/1/2030	976.822	0,03
USD 2.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 7,638% 20/10/2032	1.981.028	0,07	USD 1.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 28 7,188% 20/4/2030	990.308	0,04
USD 2.500.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 8,738% 20/10/2032	2.455.762	0,09	USD 1.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 28 8,438% 20/4/2030	956.914	0,03
USD 875.000	Goldentree Loan Management US CLO 6 7,126% 20/4/2035	863.232	0,03	USD 500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 7,538% 20/4/2031	492.515	0,02
USD 1.400.000	GoldenTree Loan Opportunities IX 7,231% 29/10/2029	1.394.963	0,05	USD 400.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 7,388% 20/7/2031	390.926	0,01
USD 1.000.000	Goldentree Loan Opportunities XII 8,495% 21/7/2030	990.030	0,04	USD 1.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 40 7,32% 16/4/2033	983.505	0,03
USD 1.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 8,588% 20/10/2034	974.810	0,03	USD 1.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 8,37% 16/7/2035	972.091	0,03
USD 1.000.000	Golub Capital Partners CLO 50B-R 8,776% 20/4/2035	996.249	0,04	USD 1.500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 8,42% 16/10/2034	1.468.297	0,05
USD 2.000.000	Grippen Park CLO 7,888% 20/1/2030	2.006.931	0,07	USD 1.500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 47 7,361% 14/4/2035	1.464.387	0,05
USD 1.400.000	GT Loan Financing I 2013-1 7,727% 28/7/2031	1.399.955	0,05	USD 4.000.000	OCP CLO 2014-7 7,838% 20/7/2029	3.971.450	0,14
USD 385.000	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5,75% 20/1/2026*	356.455	0,01				
USD 778.000	IHS 5,625% 29/11/2026	671.834	0,03				
USD 400.000	IHS 6,25% 29/11/2028	321.918	0,01				
USD 2.000.000	Invesco CLO 8,47% 15/7/2034	1.961.420	0,07				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 6.750.000	OCP CLO 2016-11 8,062% 26/10/2030	6.732.252	0,24	USD 1.000.000	Silver Creek CLO 8,938% 20/7/2030	996.239	0,04
USD 1.000.000	Octagon Investment Partners 26 7,37% 15/7/2030	969.058	0,03	USD 75.881	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	75.964	0,00
USD 1.000.000	Octagon Investment Partners 33 7,438% 20/1/2031	981.462	0,03	USD 439.000	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	440.345	0,02
USD 1.000.000	Octagon Investment Partners XVI 7,42% 17/7/2030	974.576	0,03	USD 300.000	Sunac China 7% 9/7/2025	33.000	0,00
USD 1.000.000	Octagon Investment Partners XXII 7,507% 22/1/2030	980.015	0,03	USD 2.000.000	TICP CLO IX 8,488% 20/1/2031	1.978.509	0,07
USD 700.000	OHA Credit Partners XI 8,538% 20/1/2032	689.052	0,02	USD 2.500.000	TICP CLO V 2016-1 8,72% 17/7/2031	2.462.460	0,09
USD 1.700.000	OHA Loan Funding 2013-1 8,657% 23/7/2031	1.679.737	0,06	USD 1.534.000	Transocean 7,5% 15/1/2026	1.509.223	0,05
USD 500.000	OHA Loan Funding 2013-2 7,489% 23/5/2031	493.423	0,02	USD 643.000	Transocean 8% 1/2/2027	625.957	0,02
USD 1.000.000	OZLM XX 7,538% 20/4/2031	969.603	0,03	USD 2.283.800	Transocean 8,75% 15/2/2030	2.346.942	0,08
USD 1.300.000	Palmer Square CLO 2014-1 7,42% 17/1/2031	1.285.203	0,05	USD 1.577.000	Transocean 11,5% 30/1/2027	1.662.134	0,06
USD 1.000.000	Palmer Square CLO 2014-1 8,22% 17/1/2031	989.308	0,04	USD 551.000	Transocean Titan Financing 8,375% 1/2/2028	566.842	0,02
USD 2.250.000	Palmer Square CLO 2020-3 8,576% 15/11/2031	2.224.490	0,08	USD 750.000	TRESTLES CLO II 7,283% 25/7/2031	746.578	0,03
USD 1.700.000	Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 7,439% 23/8/2031	1.677.200	0,06	USD 500.000	TRESTLES CLO II 7,513% 25/7/2031	490.742	0,02
USD 1.000.000	Peace Park CLO 8,538% 20/10/2034	977.836	0,03	USD 750.000	TRESTLES CLO II 8,513% 25/7/2031	750.142	0,03
USD 1.000.000	Pikes Peak CLO 6 7,691% 18/5/2034	973.894	0,03	USD 750.000	Webster Park CLO 8,488% 20/7/2030	716.370	0,03
USD 1.250.000	Pikes Peak CLO 6 8,741% 18/5/2034	1.226.454	0,04	USD 2.500.000	Whetstone Park CLO 8,488% 20/1/2035	2.391.797	0,08
USD 1.000.000	Pikes Peak CLO 6 12,071% 18/5/2034	990.171	0,04	USD 1.789.000	Wynn Macau 5,625% 26/8/2028*	1.571.556	0,05
USD 2.600.000	Pikes Peak CLO 8 7,588% 20/7/2034	2.544.050	0,09	USD 595.000	Wynn Macau 5,625% 26/8/2028	522.681	0,02
USD 1.700.000	Pikes Peak CLO 8 8,688% 20/7/2034	1.685.234	0,06			222.534.656	7,84
USD 1.500.000	PPM CLO 3 8,67% 17/4/2034	1.436.365	0,05	Chili			
USD 1.000.000	PPM CLO 4 8,722% 18/10/2034	935.723	0,03	USD 1.093.000	Chile Government International Bond 4,34% 7/3/2042	940.013	0,03
USD 1.250.000	PPM CLO 5 7,572% 18/10/2034	1.221.987	0,04	USD 560.000	Empresa Nacional del Petroleo 3,75% 5/8/2026	526.812	0,02
USD 1.250.000	PPM CLO 5 8,622% 18/10/2034	1.202.788	0,04	USD 515.000	Empresa Nacional del Petroleo 6,15% 10/5/2033	509.762	0,02
USD 6.700.000	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4% 24/8/2040	6.004.583	0,21	USD 651.000	Engie Energia Chile 3,4% 28/1/2030*	545.649	0,02
USD 1.000.000	Regatta XI Funding 8,42% 17/7/2031	986.610	0,04			2.522.236	0,09
USD 2.000.000	Regatta XII Funding 8,67% 15/10/2032	1.969.469	0,07	Colombie			
USD 1.750.000	Regatta XV Funding 8,913% 25/10/2031	1.728.115	0,06	USD 2.200.000	Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031	1.696.750	0,06
USD 1.000.000	Regatta XVI Funding 8,27% 15/1/2033	1.012.432	0,04	EUR 304.000	Colombia Government International Bond 3,875% 22/3/2026	317.704	0,01
USD 2.688.000	Regatta XVI Funding 9,47% 15/1/2033	2.682.624	0,10	USD 873.000	Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	805.657	0,03
USD 1.000.000	Riserva CLO 8,822% 18/1/2034	967.477	0,03	USD 1.419.000	Colombia Government International Bond 4,5% 28/1/2026	1.369.463	0,05
USD 1.250.000	RR 3 7,37% 15/1/2030	1.225.000	0,04	USD 1.015.000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033*	1.050.484	0,04
USD 286.000	Sands China 4,3% 8/1/2026	267.925	0,01	USD 1.094.000	Ecopetrol 4,125% 16/1/2025	1.060.031	0,04
USD 465.000	Sands China 5,65% 8/8/2028	437.925	0,01	USD 670.000	Ecopetrol 5,875% 28/5/2045	468.595	0,01
USD 906.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	951.978	0,04	USD 1.056.000	Ecopetrol 8,875% 13/1/2033	1.069.200	0,04
USD 1.161.000	Seagate HDD Cayman 8,5% 15/7/2031	1.217.083	0,04	USD 435.000	Promigas / Gases del Pacifico 3,75% 16/10/2029	366.923	0,01
				USD 1.038.000	SURA Asset Management 4,875% 17/4/2024	1.026.587	0,04
						9.231.394	0,33

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Costa Rica				USD 3.717.000	Iliad 6,5% 15/10/2026	3.544.793	0,13
USD 530.000	Costa Rica Government International Bond 6,55% 3/4/2034	534.746	0,02	USD 1.783.000	Iliad 7% 15/10/2028	1.661.146	0,06
Côte d'Ivoire				USD 3.200.000	Societe Generale 5,375% 18/11/2030*	2.419.850	0,08
EUR 357.000	Ivory Coast Government International Bond 5,875% 17/10/2031	324.741	0,01	USD 2.300.000	Societe Generale 8% 29/9/2025	2.262.214	0,08
USD 1.864.000	Ivory Coast Government International Bond 6,375% 3/3/2028	1.766.681	0,06	Allemagne			
				31.375.664 1,11			
				USD 1.000.000	Allianz 3,2% 30/10/2027*	760.719	0,03
				USD 2.000.000	Allianz 3,5% 17/11/2025	1.679.967	0,06
				USD 771.000	Cheplapharm Arzneimittel 5,5% 15/1/2028	698.676	0,02
				USD 3.800.000	Deutsche Bank 6% 30/10/2025	3.074.041	0,11
				USD 2.256.000	TK Elevator Holdco 7,625% 15/7/2028	2.080.648	0,07
Danemark				8.294.051 0,29			
USD 6.365.000	Danske Bank 7% 26/6/2025	6.077.550	0,21	Guatemala			
République dominicaine				USD 953.000	Guatemala Government Bond 3,7% 7/10/2033	771.058	0,03
USD 600.000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6,75% 30/3/2029	586.854	0,02	USD 1.283.000	Guatemala Government Bond 4,65% 7/10/2041	1.011.132	0,03
USD 1.141.000	Dominican Republic International Bond 4,5% 30/1/2030	997.759	0,03	USD 522.000	Guatemala Government Bond 5,25% 10/8/2029	497.351	0,02
USD 1.842.000	Dominican Republic International Bond 4,875% 23/9/2032	1.562.642	0,06	USD 515.000	Guatemala Government Bond 6,6% 13/6/2036	517.318	0,02
USD 1.000.000	Dominican Republic International Bond 5,95% 25/1/2027	978.985	0,03	2.796.859 0,10			
USD 712.000	Dominican Republic International Bond 6,875% 29/1/2026	717.760	0,03	Hongrie			
USD 375.000	Dominican Republic International Bond 7,05% 3/2/2031*	372.613	0,01	USD 1.060.000	Hungary Government International Bond 5,25% 16/6/2029	1.037.655	0,04
				USD 178.000	Hungary Government International Bond 5,375% 25/3/2024	177.696	0,00
				1.215.351 0,04			
Égypte				Indonésie			
USD 600.000	Egypt Government International Bond 7,5% 16/2/2061	304.161	0,01	USD 1.069.000	Freeport Indonesia 4,763% 14/4/2027	1.031.478	0,04
USD 530.000	Egypt Government International Bond 8,5% 31/1/2047	282.514	0,01	USD 1.090.000	Indonesia Government International Bond 4,1% 24/4/2028*	1.044.932	0,04
				USD 895.000	Indonesia Government International Bond 6,75% 15/1/2044*	1.026.261	0,03
				USD 1.112.000	Pertamina Persero 3,65% 30/7/2029*	1.018.694	0,03
				USD 555.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,4% 6/6/2027*	543.190	0,02
				4.664.555 0,16			
Finlande				Irlande			
USD 1.245.000	Nordea Bank 3,75% 1/3/2029	939.181	0,03	USD 685.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5,25% 15/8/2027	588.679	0,02
USD 2.550.000	Nordea Bank 6,625% 26/3/2026	2.422.462	0,09	USD 600.000	ASG Finance Designated Activity 7,875% 3/12/2024	585.540	0,02
				USD 70.000	Castlelake Aviation Finance 5% 15/4/2027	64.425	0,01
				USD 980.000	Jazz 4,375% 15/1/2029	879.457	0,03
				USD 2.050.000	LCPR Senior Secured Financing 6,75% 15/10/2027	1.933.344	0,07
				USD 383.000	Motion Bondco 6,625% 15/11/2027	356.103	0,01
				USD 2.602.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV 5% 15/7/2028	2.304.882	0,08
				6.712.430 0,24			
France							
USD 996.000	Altice France 5,125% 15/1/2029	714.163	0,03				
USD 1.773.000	Altice France 5,125% 15/7/2029	1.261.141	0,04				
USD 2.754.000	Altice France 5,5% 15/1/2028	2.068.335	0,07				
USD 2.094.000	Altice France 5,5% 15/10/2029	1.512.555	0,05				
USD 5.750.000	BNP Paribas 4,625% 25/2/2031*	4.198.421	0,15				
USD 790.000	BNP Paribas 7% 16/8/2028	730.957	0,03				
USD 495.000	BNP Paribas 8,5% 14/8/2028*	495.148	0,02				
USD 3.136.000	Constellium 3,75% 15/4/2029	2.695.609	0,09				
USD 543.000	Constellium 5,625% 15/6/2028	513.774	0,02				
USD 1.020.000	Constellium 5,875% 15/2/2026	1.005.321	0,04				
USD 3.595.000	Credit Agricole 4,75% 23/3/2029	2.821.437	0,10				
USD 3.264.000	Credit Agricole 8,125% 23/12/2025	3.261.960	0,11				
USD 200.000	Electricite de France 9,125% 15/3/2033	208.840	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Île de Man				USD 2.824.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	2.389.778	0,08
USD 901.000	AngloGold Ashanti 3,75% 1/10/2030	749.452	0,03	USD 1.392.000	Altice Financing 5% 15/1/2028*	1.134.179	0,04
Israël				USD 2.033.000	Altice Financing 5,75% 15/8/2029*	1.613.030	0,06
USD 533.000	Bank Leumi Le-Israel 7,129% 18/7/2033	527.603	0,02	USD 3.252.949	ARD Finance 6,5% 30/6/2027	2.621.883	0,09
USD 1.158.000	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033	1.173.923	0,04	USD 349.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	3.490	0,00
USD 925.000	Leviathan Bond 6,75% 30/6/2030*	868.547	0,03	USD 5.788.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	5.494.051	0,20
		2.570.073	0,09	USD 1.179.000	EIG Pearl 3,545% 31/8/2036*	982.325	0,04
Italie				USD 2.804.000	Herens Holdco 4,75% 15/5/2028*	2.156.759	0,08
USD 1.608.000	F-Brasile / F-Brasile US 7,375% 15/8/2026*	1.477.922	0,05	USD 549.000	ION Trading Technologies 5,75% 15/5/2028	482.767	0,02
USD 6.270.000	UniCredit 8% 3/6/2024	6.183.788	0,22	USD 622.000	Kenbourne Invest 6,875% 26/11/2024	523.575	0,02
		7.661.710	0,27	USD 1.259.992	MC Brazil Downstream Trading 7,25% 30/6/2031	818.289	0,03
Jamaïque				USD 404.000	MHP Lux 6,25% 19/9/2029	223.974	0,01
USD 467.000	Digicel International Finance/ Digicel international 8,75% 25/5/2024	427.765	0,01	USD 200.000	MHP Lux 6,95% 3/4/2026	117.136	0,00
Jersey				USD 720.000	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028*	648.450	0,02
USD 2.000.000	Boyce Park CLO 7,434% 21/4/2035	1.954.986	0,07	USD 917.000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	844.383	0,03
USD 5.000.000	Golub Capital Partners CLO 66B 6,926% 25/4/2036	5.034.941	0,18	USD 124.000	Puma International Financing 5,125% 6/10/2024	122.883	0,00
USD 4.000.000	Golub Capital Partners CLO 66B 7,676% 25/4/2036	4.015.658	0,14	USD 1.198.000	SK Invictus Intermediate II 5% 30/10/2029*	975.982	0,03
USD 2.000.000	Golub Capital Partners CLO 66B 8,276% 25/4/2036	2.008.717	0,07	USD 1.803.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	1.497.636	0,05
USD 1.300.000	Golub Capital Partners CLO 66B 10,476% 25/4/2036	1.306.429	0,05	USD 745.000	Telecom Italia Capital 6,375% 15/11/2033	651.814	0,02
USD 5.000.000	Pikes Peak CLO 14 2023 7,145% 20/4/2036	5.021.000	0,18	USD 2.000	Telecom Italia Capital 7,2% 18/7/2036	1.800	0,00
USD 4.000.000	Pikes Peak CLO 14 2023 7,695% 20/4/2036	4.002.728	0,14	USD 96.000	Telecom Italia Capital 7,721% 4/6/2038	88.405	0,00
USD 2.000.000	Pikes Peak CLO 14 2023 10,645% 20/4/2036	2.015.269	0,07			26.225.113	0,93
		25.359.728	0,90	Malte			
Jordanie				USD 428.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6,375% 1/2/2030	351.170	0,01
USD 507.000	Jordan Government International Bond 4,95% 7/7/2025	495.047	0,02	USD 265.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 7,875% 1/5/2027*	240.356	0,01
Liberia						591.526	0,02
USD 511.000	Royal Caribbean Cruises 5,375% 15/7/2027	480.456	0,02	Maurice			
USD 160.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 31/8/2026	153.880	0,01	USD 1.999.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	1.795.582	0,06
USD 588.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 1/4/2028	552.653	0,02	USD 450.000	Diamond II 7,95% 28/7/2026	443.316	0,02
USD 907.000	Royal Caribbean Cruises 7,25% 15/1/2030	921.465	0,03	USD 1.000.000	HTA 7% 18/12/2025	949.020	0,03
USD 282.000	Royal Caribbean Cruises 8,25% 15/1/2029	294.882	0,01	USD 400.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024	394.000	0,02
USD 719.000	Royal Caribbean Cruises 9,25% 15/1/2029	766.328	0,03			3.581.918	0,13
USD 115.000	Royal Caribbean Cruises 11,5% 1/6/2025	121.661	0,00	Mexique			
USD 573.000	Royal Caribbean Cruises 11,625% 15/8/2027	624.983	0,02	USD 500.000	Banco Mercantil del Norte 5,875% 24/1/2027	441.525	0,02
		3.916.308	0,14	USD 845.000	Braskem Idesa SAPI 6,99% 20/2/2032	504.325	0,02
Luxembourg				USD 1.056.000	Comision Federal de Electricidad 4,875% 15/1/2024	1.049.701	0,04
USD 437.000	Albion Financing 1 / Aggreko 6,125% 15/10/2026	412.400	0,02	USD 1.335.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	1.105.473	0,04
USD 2.861.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	2.420.124	0,09	USD 982.000	Mexico Government International Bond 3,75% 11/1/2028	931.648	0,03

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 215.000	Mexico Government International Bond 6,338% 4/5/2053*	214.355	0,01	USD 601.000	Ziggo Bond 5,125% 28/2/2030	466.438	0,02
USD 235.000	Mexico Government International Bond 6,35% 9/2/2035	244.070	0,01	USD 150.000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	139.707	0,00
EUR 242.000	Petroleos Mexicanos 3,75% 21/2/2024	258.834	0,01			19.976.478	0,70
USD 563.000	Petroleos Mexicanos 4,25% 15/1/2025*	532.826	0,02		Nigéria		
USD 1.200.000	Petroleos Mexicanos 5,95% 28/1/2031	869.460	0,03	USD 966.000	Nigeria Government International Bond 7,625% 28/11/2047*	663.497	0,02
USD 1.000.000	Petroleos Mexicanos 6,5% 13/3/2027*	878.400	0,03	USD 644.000	Nigeria Government International Bond 8,375% 24/3/2029	567.532	0,02
USD 1.380.000	Petroleos Mexicanos 6,7% 16/2/2032	1.044.798	0,04			1.231.029	0,04
USD 1.071.000	Petroleos Mexicanos 8,75% 2/6/2029	958.288	0,03		Oman		
USD 663.000	Trust Fibra Uno 5,25% 30/1/2026	641.098	0,02	USD 1.000.000	Oman Government International Bond 6,5% 8/3/2047	941.265	0,03
		9.674.801	0,35	USD 1.200.000	Oman Government International Bond 6,75% 17/1/2048	1.160.442	0,04
				USD 553.000	Oman Sovereign Sukuk 4,397% 1/6/2024*	544.575	0,02
				USD 400.000	OQ SAOC 5,125% 6/5/2028	383.084	0,01
						3.029.366	0,10
	Maroc				Panama		
USD 592.000	Morocco Government International Bond 2,375% 15/12/2027	516.239	0,02	USD 400.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5,125% 11/8/2061	300.192	0,01
USD 550.000	Morocco Government International Bond 5,95% 8/3/2028	550.775	0,02	USD 615.440	AES Panama Generation 4,375% 31/5/2030	536.202	0,02
USD 600.000	OCP 5,125% 23/6/2051	424.788	0,01	USD 1.659.000	Carnival 4% 1/8/2028	1.489.490	0,05
		1.491.802	0,05	USD 3.247.000	Carnival 5,75% 1/3/2027	3.049.863	0,11
				USD 733.000	Carnival 6% 1/5/2029	659.124	0,02
				USD 374.000	Carnival 7,625% 1/3/2026	373.158	0,01
				USD 324.000	Carnival 9,875% 1/8/2027	342.695	0,01
				USD 1.297.000	Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030*	1.128.734	0,04
				USD 487.000	Panama Government International Bond 3,875% 17/3/2028	458.503	0,02
				USD 1.105.000	Panama Government International Bond 6,4% 14/2/2035	1.134.734	0,04
				USD 915.000	Panama Government International Bond 6,853% 28/3/2054	932.202	0,03
						10.404.897	0,36
					Paraguay		
				USD 847.000	Paraguay Government International Bond 5,6% 13/3/2048	727.895	0,03
					Pérou		
				USD 1.062.000	Financiera de Desarrollo 4,75% 15/7/2025	1.041.572	0,04
				USD 1.877.000	Peruvian Government International Bond 1,862% 1/12/2032	1.417.323	0,05
				USD 985.000	Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031	836.260	0,03
						3.295.155	0,12
					Pologne		
				EUR 680.000	Republic of Poland Government International Bond 4,25% 14/2/2043	721.174	0,02
				USD 506.000	Republic of Poland Government International Bond 4,875% 4/10/2033*	491.293	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 675.000	ACI Worldwide 5,75% 15/8/2026	660.910	0,02	USD 268.000	APi DE 4,125% 15/7/2029	231.861	0,01
USD 304.000	Acrisure / Acrisure Finance 6% 1/8/2029	264.177	0,01	USD 251.000	APi DE 4,75% 15/10/2029	227.183	0,01
USD 1.555.000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	1.261.020	0,04	USD 912.000	APX 5,75% 15/7/2029	787.367	0,03
USD 60.000	AdaptHealth 5,125% 1/3/2030	49.485	0,00	USD 1.089.000	APX 6,75% 15/2/2027	1.054.917	0,04
USD 166.000	AdaptHealth 6,125% 1/8/2028	149.977	0,01	USD 2.304.000	Aramark Services 5% 1/2/2028	2.152.175	0,08
USD 1.204.000	ADT Security 4,875% 15/7/2032	1.040.325	0,04	USD 547.000	Aramark Services 6,375% 1/5/2025*	549.006	0,02
USD 1.553.000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8,25% 15/2/2026	1.562.163	0,06	USD 225.000	Arches Buyer 4,25% 1/6/2028	196.186	0,01
USD 269.000	Ahead DB 6,625% 1/5/2028	232.569	0,01	USD 3.448.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,25% 1/4/2028	3.300.253	0,12
USD 1.025.000	AHP Health Partners 5,75% 15/7/2029	875.972	0,03	USD 856.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,875% 1/4/2027	842.860	0,03
USD 1.156.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5,875% 15/2/2028	1.122.647	0,04	USD 678.000	Arcosa 4,375% 15/4/2029	607.047	0,02
USD 505.000	Alexander Funding Trust II 7,467% 31/7/2028	510.540	0,02	USD 5.999.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029*	4.877.008	0,17
USD 372.000	Allegiant Travel 7,25% 15/8/2027	364.487	0,01	USD 973.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	953.915	0,03
USD 1.631.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4,25% 15/10/2027	1.485.497	0,05	USD 456.000	Arko 5,125% 15/11/2029	375.101	0,01
USD 3.984.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 5,875% 1/11/2029	3.488.643	0,12	USD 362.000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	369.229	0,01
USD 8.996.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/10/2027	8.505.721	0,30	USD 175.000	Asbury Automotive 4,5% 1/3/2028	159.767	0,01
USD 3.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/4/2028	2.959	0,00	USD 79.000	Asbury Automotive 4,75% 1/3/2030	69.256	0,00
USD 4.081.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6% 1/6/2029	3.124.428	0,11	USD 433.000	Asbury Automotive 5% 15/2/2032	371.161	0,01
USD 3.680.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6,625% 15/7/2026	3.507.358	0,12	USD 2.827.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5,875% 30/6/2029	2.576.851	0,09
USD 2.551.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 9,75% 15/7/2027*	2.344.112	0,08	USD 1.052.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 9% 1/11/2027	1.327.124	0,05
USD 6.250.000	Ally Financial 4,7% 15/5/2026	4.402.151	0,16	USD 3.852.000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 7,583% 15/4/2035	3.704.532	0,13
USD 607.000	Alteryx 8,75% 15/3/2028*	587.273	0,02	USD 1.180.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	1.017.573	0,04
USD 236.000	AMC Networks 4,25% 15/2/2029	150.896	0,01	USD 169.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/4/2030	144.244	0,01
USD 208.000	American Airlines 7,25% 15/2/2028	204.660	0,01	USD 120.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6,625% 15/1/2028	115.033	0,00
USD 590.409	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,5% 20/4/2026	580.612	0,02	USD 284.372	Asset Backed Home Equity Loan Trust Series 2004-HE9 6,404% 25/12/2034	250.660	0,01
USD 2.128.917	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,75% 20/4/2029*	2.045.935	0,07	USD 6.981.000	AthenaHealth 6,5% 15/2/2030	6.053.929	0,21
USD 4.720.000	American Express 3,55% 15/9/2026	3.930.469	0,14	USD 253.000	ATI 4,875% 1/10/2029	228.670	0,01
USD 882.000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9,375% 1/6/2028	902.032	0,03	USD 796.000	ATI 5,125% 1/10/2031	704.508	0,02
USD 154.000	AMN Healthcare 4% 15/4/2029	131.816	0,00	USD 863.000	Avantor Funding 3,875% 1/11/2029	756.937	0,03
USD 1.408.000	AmWINS 4,875% 30/6/2029	1.264.253	0,04	USD 1.043.000	Avantor Funding 4,625% 15/7/2028	968.821	0,03
USD 396.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,375% 15/6/2029	371.505	0,01	USD 396.000	Avient 7,125% 1/8/2030	396.881	0,01
USD 296.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,75% 1/3/2027	287.245	0,01	USD 502.000	Axalta Coating Systems 3,375% 15/2/2029	426.201	0,01
USD 72.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,75% 15/1/2028	69.029	0,00	USD 1.152.000	Axalta Coating Systems / Axalta Coating Systems Dutch B 4,75% 15/6/2027	1.084.549	0,04
USD 334.000	Antero Resources 7,625% 1/2/2029	340.810	0,01	USD 599.000	Azul Investments 5,875% 26/10/2024	551.080	0,02
USD 848.800	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	771.554	0,03	USD 537.000	Azul Secured Finance 11,93% 28/8/2028*	534.774	0,02
USD 346.000	Apache 5,35% 1/7/2049	277.992	0,01	USD 4.481.704	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 7,058% 15/9/2034	4.440.187	0,16

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 258.744	Banc of America Mortgage 2007-4 Trust 6,25% 28/12/2037	208.392	0,01	USD 812.000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	800.441	0,03
USD 3.750.000	Bank of New York Mellon 3,7% 20/3/2026	3.371.001	0,12	USD 640.000	Carpenter Technology 7,625% 15/3/2030	645.169	0,02
USD 2.137.655	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5,679% 25/10/2036	1.975.716	0,07	USD 693.839	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 5,689% 25/2/2037	644.414	0,02
USD 2.504.064	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 6,104% 25/9/2037	2.293.635	0,08	USD 191.000	CCM Merger 6,375% 1/5/2026	185.584	0,01
USD 1.570.000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 4,409% 5/8/2038	1.032.411	0,04	USD 1.469.000	CCO / CCO Capital 4,25% 1/2/2031	1.209.526	0,04
USD 1.325.000	BCPE Empire 7,625% 1/5/2027	1.250.005	0,04	USD 668.000	CCO / CCO Capital 4,25% 15/1/2034	512.257	0,02
USD 1.940.000	BDS 2022-FL12 7,45% 19/8/2038	1.937.189	0,07	USD 706.000	CCO / CCO Capital 4,5% 15/8/2030	595.180	0,02
USD 4.414.000	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust 3,257% 15/7/2051	2.816.248	0,10	USD 344.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/3/2030	296.941	0,01
USD 4.708.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	4.687.496	0,17	USD 681.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/2/2032	565.376	0,02
USD 51.000	Block Communications 4,875% 1/3/2028	42.254	0,00	USD 197.000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	181.718	0,01
USD 555.000	Blue Owl Credit Income 5,5% 21/3/2025	538.044	0,02	USD 1.056.000	CCO / CCO Capital 6,375% 1/9/2029	1.002.095	0,04
USD 632.000	Blue Owl Credit Income 7,75% 16/9/2027	628.061	0,02	USD 5.718.000	CCO / CCO Capital 7,375% 1/3/2031	5.689.037	0,20
USD 883.000	Boxer Parent 7,125% 2/10/2025	884.899	0,03	USD 568.000	CD&R Smokey Buyer 6,75% 15/7/2025*	553.573	0,02
USD 1.936.000	Boxer Parent 9,125% 1/3/2026	1.939.386	0,07	USD 1.334.000	CDI Escrow Issuer 5,75% 1/4/2030	1.246.538	0,04
USD 157.000	Boyd Gaming 4,75% 1/12/2027	147.238	0,01	USD 62.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 6,5% 1/10/2028	60.029	0,00
USD 1.630.000	Boyd Gaming 4,75% 15/6/2031	1.442.077	0,05	USD 12.000	Central Garden & Pet 4,125% 15/10/2030	10.340	0,00
USD 606.000	Boyne USA 4,75% 15/5/2029	546.895	0,02	USD 330.000	Central Garden & Pet 4,125% 30/4/2031	281.866	0,01
USD 4.391.000	Brand Industrial Services 10,375% 1/8/2030	4.509.626	0,16	USD 2.570.000	Central Parent / CDK Global 7,25% 15/6/2029	2.539.844	0,09
USD 402.000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGSi Sellco LL 4,5% 1/4/2027	336.148	0,01	USD 1.144.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	1.159.449	0,04
USD 14.000	Buckeye Partners 4,125% 1/3/2025	13.471	0,00	USD 3.775.000	Charles Schwab 4% 1/6/2026	3.261.028	0,12
USD 245.000	Buckeye Partners 5,6% 15/10/2044	180.362	0,01	USD 4.220.000	Charles Schwab 4% 1/12/2030	3.170.274	0,11
USD 343.000	Buckeye Partners 5,85% 15/11/2043	265.199	0,01	USD 1.449.000	Chart Industries 7,5% 1/1/2030	1.488.697	0,05
USD 275.000	Cable One 0% 15/3/2026	227.406	0,01	USD 795.000	Chart Industries 9,5% 1/1/2031	857.769	0,03
USD 140.000	Cable One 4% 15/11/2030	109.317	0,00	USD 182.000	Chemours 4,625% 15/11/2029	151.454	0,01
USD 254.000	Cablevision Lightpath 3,875% 15/9/2027	211.544	0,01	USD 288.000	Chemours 5,75% 15/11/2028	258.117	0,01
USD 665.000	Cablevision Lightpath 5,625% 15/9/2028	511.798	0,02	USD 1.084.000	Cheniere Energy Partners 4,5% 1/10/2029	1.000.636	0,04
USD 2.633.000	Caesars Entertainment 4,625% 15/10/2029	2.310.066	0,08	USD 58.000	Chesapeake Energy 5,875% 1/2/2029	55.549	0,00
USD 2.802.000	Caesars Entertainment 6,25% 1/7/2025	2.782.044	0,10	USD 2.224.000	Chesapeake Energy 6,75% 15/4/2029	2.209.743	0,08
USD 3.678.000	Caesars Entertainment 8,125% 1/7/2027*	3.741.328	0,13	USD 1.774.000	Chobani / Chobani Finance 4,625% 15/11/2028	1.593.423	0,06
USD 400.000	Caesars Resort Collection / CRC Finco 5,75% 1/7/2025	400.477	0,01	USD 3.270.000	Chobani / Chobani Finance 7,5% 15/4/2025	3.265.293	0,12
USD 539.000	Callon Petroleum 6,375% 1/7/2026	532.451	0,02	USD 1.638.000	CHS/Community Health Systems 4,75% 15/2/2031	1.232.431	0,04
USD 2.232.000	Callon Petroleum 7,5% 15/6/2030	2.197.434	0,08	USD 2.085.000	CHS/Community Health Systems 5,25% 15/5/2030	1.644.954	0,06
USD 1.717.000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	1.741.712	0,06	USD 1.407.000	CHS/Community Health Systems 5,625% 15/3/2027	1.244.225	0,04
USD 342.000	Calpine 4,625% 1/2/2029	297.550	0,01	USD 2.026.000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	1.699.064	0,06
USD 198.000	Calpine 5% 1/2/2031	168.021	0,01	USD 1.912.000	Churchill Downs 4,75% 15/1/2028	1.767.226	0,06
USD 2.622.000	Calpine 5,125% 15/3/2028*	2.397.782	0,08	USD 671.000	CITGO Petroleum 6,375% 15/6/2026	655.695	0,02
USD 544.000	Camelot Return Merger Sub 8,75% 1/8/2028*	539.332	0,02	USD 593.000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	587.752	0,02
USD 2.700.000	Capital One Financial 3,95% 1/9/2026	2.045.714	0,07				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.000.000	Citigroup Mortgage Loan Trust 7,929% 25/7/2037	1.904.943	0,07	USD 302.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	294.065	0,01
USD 2.101.000	Civitas Resources 8,375% 1/7/2028	2.159.835	0,08	USD 116.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 8% 1/4/2029	119.905	0,00
USD 1.666.000	Civitas Resources 8,75% 1/7/2031	1.721.997	0,06	USD 289.000	Crocs 4,125% 15/8/2031	229.293	0,01
USD 905.000	Clarios Global 6,75% 15/5/2025	906.676	0,03	USD 29.000	Crocs 4,25% 15/3/2029	24.479	0,00
USD 1.962.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,25% 15/5/2026	1.944.208	0,07	USD 106.000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	98.175	0,00
USD 8.860.000	Clarios Global / Clarios US Finance 8,5% 15/5/2027	8.965.709	0,32	USD 2.101.000	CrownRock / CrownRock Finance 5,625% 15/10/2025	2.066.123	0,07
USD 3.480.000	Clarivate Science 3,875% 1/7/2028	3.068.942	0,11	USD 863.000	CSC 4,125% 1/12/2030	616.174	0,02
USD 2.281.000	Clarivate Science 4,875% 1/7/2029	1.992.666	0,07	USD 440.000	CSC 4,5% 15/11/2031	313.640	0,01
USD 3.931.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	3.529.306	0,13	USD 400.000	CSC 5,5% 15/4/2027	345.206	0,01
USD 3.953.000	Clear Channel Outdoor 7,5% 1/6/2029*	2.949.637	0,10	USD 4.952.000	CSC 11,25% 15/5/2028	4.888.366	0,17
USD 88.000	Clear Channel Outdoor 7,75% 15/4/2028	68.969	0,00	USD 1.252.000	Cushman & Wakefield US Borrower 6,75% 15/5/2028	1.184.962	0,04
USD 2.461.000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	2.473.059	0,09	USD 390.000	Cushman & Wakefield US Borrower 8,875% 1/9/2031	394.341	0,01
USD 9.011.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	8.060.002	0,29	USD 589.044	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 6,15% 25/9/2046	530.226	0,02
USD 3.798.000	Cloud Software 9% 30/9/2029	3.396.751	0,12	USD 560.000	DAE Funding 1,55% 1/8/2024	535.847	0,02
USD 1.000.000	Clover CLO 2021-3 8,713% 25/1/2035	995.477	0,03	USD 283.000	DAE Funding 2,625% 20/3/2025	266.327	0,01
USD 2.266.000	Clydesdale Acquisition 6,625% 15/4/2029	2.159.400	0,08	USD 977.726	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7,606% 15/5/2035	952.965	0,03
USD 1.784.000	Clydesdale Acquisition 8,75% 15/4/2030	1.614.138	0,06	USD 923.000	DBGS 2019-1735 Mortgage Trust 4,334% 10/4/2037	570.660	0,02
USD 918.000	CMG Media 8,875% 15/12/2027	721.068	0,03	USD 424.000	Dealer Tire / DT Issuer 8% 1/2/2028	396.216	0,01
USD 1.248.000	CNX Midstream Partners 4,75% 15/4/2030	1.078.134	0,04	USD 1.864.000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5,875% 15/8/2027	1.655.940	0,06
USD 304.000	CNX Resources 7,375% 15/1/2031	303.428	0,01	USD 3.600.000	Discover Financial Services 5,5% 30/10/2027	2.697.122	0,10
USD 1.537.000	Coherent 5% 15/12/2029	1.361.172	0,05	USD 2.368.000	DISH DBS 5,125% 1/6/2029	1.282.509	0,05
USD 2.900.000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3,183% 10/2/2048	2.776.995	0,10	USD 3.788.000	DISH DBS 5,25% 1/12/2026	3.208.046	0,11
USD 962.000	CommScope 4,75% 1/9/2029	715.565	0,03	USD 18.000	DISH DBS 5,75% 1/12/2028	14.018	0,00
USD 1.342.000	CommScope 6% 1/3/2026	1.216.971	0,04	USD 2.322.000	DISH Network 11,75% 15/11/2027	2.360.475	0,08
USD 1.263.000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	1.155.749	0,04	USD 1.750.000	Dominion Energy 4,35% 15/1/2027	1.495.900	0,05
USD 385.000	Compass Diversified 5,25% 15/4/2029	353.865	0,01	USD 302.000	Dream Finders Homes 8,25% 15/8/2028	306.476	0,01
USD 1.694.000	Comstock Resources 5,875% 15/1/2030*	1.498.218	0,05	USD 244.000	DT Midstream 4,125% 15/6/2029	216.077	0,01
USD 1.124.000	Comstock Resources 6,75% 1/3/2029*	1.052.096	0,04	USD 1.041.000	DT Midstream 4,375% 15/6/2031	899.313	0,03
USD 179.000	Consensus Cloud Solutions 6% 15/10/2026	166.843	0,01	USD 3.200.000	Duke Energy 3,25% 15/1/2082	2.372.931	0,08
USD 238.000	Consensus Cloud Solutions 6,5% 15/10/2028*	214.215	0,01	USD 2.111.000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029*	1.886.788	0,07
USD 3.014.000	CoreLogic 4,5% 1/5/2028	2.466.658	0,09	USD 184.000	Dycom Industries 4,5% 15/4/2029	164.592	0,01
USD 380.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	327.171	0,01	USD 898.000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	916.773	0,03
USD 158.000	Covanta 5% 1/9/2030	134.271	0,00	USD 789.000	Earthstone Energy 9,875% 15/7/2031	863.266	0,03
USD 3.124.000	CQP Holdco / BIP-V Chinook Holdco 5,5% 15/6/2031	2.846.205	0,10	USD 5.675.000	Edison International 5,375% 15/3/2026	5.027.954	0,18
USD 2.091.000	Crescent Energy Finance 7,25% 1/5/2026	2.057.631	0,07	USD 800.000	Edison International 8,125% 15/6/2053	809.966	0,03
USD 1.057.000	Crescent Energy Finance 9,25% 15/2/2028	1.081.910	0,04	USD 3.361.000	Element Solutions 3,875% 1/9/2028	2.955.715	0,10
USD 140.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 5,625% 1/5/2027	136.002	0,01	USD 260.000	Embeta 6,75% 15/2/2030	229.428	0,01
				USD 1.062.000	Enact 6,5% 15/8/2025	1.053.265	0,04
				USD 77.000	Encompass Health 4,5% 1/2/2028	71.731	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 27.000	Encompass Health 4,625% 1/4/2031	23.669	0,00	USD 213.000	FTAI Infra Escrow 10,5% 1/6/2027	213.301	0,01
USD 130.000	Encompass Health 4,75% 1/2/2030	118.699	0,00	USD 669.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	713.472	0,03
USD 1.961.000	EnLink Midstream 5,625% 15/1/2028	1.899.196	0,07	USD 1.133.000	Gates Global / Gates 6,25% 15/1/2026	1.125.504	0,04
USD 103.000	EnLink Midstream Partners 4,85% 15/7/2026	98.976	0,00	USD 1.875.000	General Motors Financial 5,7% 30/9/2030	1.613.470	0,06
USD 160.000	EnLink Midstream Partners 5,45% 1/6/2047	132.955	0,00	USD 222.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 6,5% 1/10/2025	218.880	0,01
USD 577.000	EnLink Midstream Partners 5,6% 1/4/2044	485.719	0,02	USD 174.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7,75% 1/2/2028	169.790	0,00
USD 231.000	EnPro Industries 5,75% 15/10/2026	225.466	0,01	USD 495.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8,875% 15/4/2030	492.864	0,02
USD 318.000	Entegris Escrow 4,75% 15/4/2029	295.548	0,01	USD 2.000.000	Golub Capital Partners 48 8,37% 17/4/2033	1.990.115	0,07
USD 49.000	EQM Midstream Partners 4,125% 1/12/2026	46.057	0,00	USD 132.000	Goodyear Tire & Rubber 5% 15/7/2029	117.209	0,00
USD 248.000	EQM Midstream Partners 4,75% 15/1/2031	219.536	0,01	USD 550.000	Goodyear Tire & Rubber 5,625% 30/4/2033	472.576	0,02
USD 216.000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	214.134	0,01	USD 98.000	GrafTech Finance 4,625% 15/12/2028	76.927	0,00
USD 1.065.000	EQM Midstream Partners 6,5% 1/7/2027	1.057.863	0,04	USD 900.000	GrafTech Global Enterprises 9,875% 15/12/2028	873.342	0,03
USD 257.000	EQM Midstream Partners 7,5% 1/6/2030	263.862	0,01	USD 433.000	Gray Television 5,875% 15/7/2026	396.659	0,01
USD 597.000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	546.341	0,02	USD 260.000	Gray Television 7% 15/5/2027	233.702	0,01
USD 1.198.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4,625% 15/1/2029	1.034.402	0,04	USD 104.464	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 6,43% 25/3/2036	92.145	0,00
USD 421.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 6,75% 15/1/2030	348.386	0,01	USD 329.000	Greystar Real Estate Partners 7,75% 1/9/2030	332.093	0,01
USD 473.140	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5,669% 25/10/2036	316.107	0,01	USD 409.000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 4,554% 10/7/2048	366.537	0,01
USD 277.401	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5,749% 25/10/2036	179.703	0,01	USD 153.280	GSAA Home Equity Trust 2005-14 6,129% 25/12/2035	67.346	0,00
USD 6.800.000	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF9 5,929% 25/6/2036	5.950.189	0,21	USD 525.620	GSAA Home Equity Trust 2006-5 5,789% 25/3/2036	173.473	0,01
USD 1.576.305	First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-FF2 5,709% 25/3/2037	851.756	0,03	USD 979.462	GSAMP Trust 2006-FM3 5,569% 25/11/2036	466.764	0,02
USD 200.000	Ford Motor Credit 5,113% 3/5/2029	184.020	0,01	USD 843.756	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP3 3,816% 25/9/2035	771.061	0,03
USD 1.350.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 5,5% 1/5/2028	1.257.025	0,04	USD 784.000	GTCR AP Finance 8% 15/5/2027	776.439	0,03
USD 166.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 6,5% 1/10/2025	164.241	0,01	USD 125.000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	127.055	0,00
USD 92.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 9,75% 1/8/2027	95.734	0,00	USD 644.000	GYP III 4,625% 1/5/2029	567.107	0,02
USD 152.000	Foundation Building Materials 6% 1/3/2029	128.672	0,00	USD 83.000	Hanesbrands 4,875% 15/5/2026	77.733	0,00
USD 1.400.000	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust 4,19% 25/5/2025	1.343.969	0,05	USD 983.000	Hanesbrands 9% 15/2/2031*	987.380	0,04
USD 1.000.000	FREMF 2018-K733 Mortgage Trust 3,986% 25/2/2051	920.383	0,03	USD 133.000	Harvest Midstream I 7,5% 1/9/2028	133.533	0,00
USD 630.000	FREMF 2018-K80 Mortgage Trust 4,376% 25/8/2050	589.862	0,02	USD 317.000	HAT I / HAT II 3,375% 15/6/2026	284.722	0,01
USD 2.562.000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	2.196.108	0,08	USD 1.358.000	HB Fuller 4,25% 15/10/2028	1.213.448	0,04
USD 668.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	608.723	0,02	USD 1.506.000	HealthEquity 4,5% 1/10/2029	1.336.592	0,05
USD 4.122.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	4.001.627	0,14	USD 400.000	Helios Software / ION Corporate Solutions Finance 4,625% 1/5/2028	345.413	0,01
				USD 347.000	Hertz 4,625% 1/12/2026	313.263	0,01
				USD 452.000	Hertz 5% 1/12/2029	371.900	0,01
				USD 540.000	Hess Midstream Operations 4,25% 15/2/2030	473.074	0,02
				USD 375.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5,75% 1/2/2029	348.225	0,01
				USD 44.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6% 15/4/2030	40.880	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 185.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6,25% 1/11/2028	178.267	0,01	USD 289.000	Ken Garff Automotive 4,875% 15/9/2028	251.709	0,01
USD 90.000	Hilton Domestic Operating 3,75% 1/5/2029	79.439	0,00	USD 694.000	Kobe US Midco 2 9,25% 1/11/2026	507.487	0,02
USD 158.000	Hilton Domestic Operating 5,75% 1/5/2028	155.155	0,01	USD 272.000	Kontoor Brands 4,125% 15/11/2029	230.990	0,01
USD 3.272.000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	3.067.825	0,11	USD 998.000	LABL 5,875% 1/11/2028	904.331	0,03
USD 316.000	Howard Hughes 4,125% 1/2/2029	260.220	0,01	USD 1.286.000	LABL 9,5% 1/11/2028	1.325.404	0,05
USD 308.000	Howard Hughes 4,375% 1/2/2031	245.171	0,01	USD 135.000	Ladder Capital Finance LLLL / Ladder Capital Finance 4,75% 15/6/2029	113.597	0,00
USD 132.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	119.206	0,00	USD 83.000	Ladder Capital Finance LLLL / Ladder Capital Finance 5,25% 1/10/2025	79.974	0,00
USD 687.000	Howard Midstream Energy Partners 8,875% 15/7/2028	706.752	0,03	USD 579.000	LCM Investments II 4,875% 1/5/2029	503.019	0,02
USD 1.303.815	HSI Asset Loan Obligation Trust 2007-WF1 4,367% 25/12/2036	408.710	0,01	USD 624.000	LCM Investments II 8,25% 1/8/2031	624.892	0,02
USD 3.634.000	HUB International 7% 1/5/2026	3.631.546	0,13	USD 272.000	Legacy LifePoint Health 4,375% 15/2/2027	235.280	0,01
USD 505.000	HUB International 7,25% 15/6/2030	511.843	0,02	USD 193.000	Legends Hospitality Co / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	179.664	0,01
USD 198.000	Hughes Satellite Systems 5,25% 1/8/2026	180.775	0,01	USD 1.759.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	1.610.473	0,06
USD 850.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4,375% 1/2/2029*	672.754	0,02	USD 148.000	Level 3 Financing 3,625% 15/1/2029	88.244	0,00
USD 3.410.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5,25% 15/5/2027	2.989.114	0,11	USD 1.866.000	Level 3 Financing 4,625% 15/9/2027	1.405.640	0,05
USD 325.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6,25% 15/5/2026	301.797	0,01	USD 2.397.000	Level 3 Financing 10,5% 15/5/2030	2.436.204	0,09
USD 3.000.000	ILFC E-Capital Trust I 7,064% 21/12/2065	2.177.686	0,08	USD 1.250.000	Liberty Mutual 4,125% 15/12/2051	1.007.244	0,04
USD 3.000.000	ILFC E-Capital Trust II 7,314% 21/12/2065	2.201.250	0,08	USD 1.187.000	Life Time 5,75% 15/1/2026	1.158.695	0,04
USD 1.785.000	Illuminate Buyer / Illuminate IV 9% 1/7/2028	1.654.294	0,06	USD 976.000	Life Time 8% 15/4/2026	974.975	0,03
USD 2.136.000	Imola Merger 4,75% 15/5/2029	1.902.533	0,07	USD 848.000	LifePoint Health 9,875% 15/8/2030	837.058	0,03
USD 219.000	Installed Building Products 5,75% 1/2/2028	205.858	0,01	USD 697.420	Ligado Networks 15,5% 1/11/2023	242.357	0,01
USD 1.013.207	Invitation Homes 2018-SFR4 Trust 6,525% 17/1/2038	1.013.210	0,04	USD 372.000	Light & Wonder International 7% 15/5/2028	371.353	0,01
USD 969.000	Iron Mountain 5,625% 15/7/2032	870.631	0,03	USD 56.000	Light & Wonder International 7,25% 15/11/2029	56.120	0,00
USD 623.000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	622.596	0,02	USD 1.040.000	Lindblad Expeditions 6,75% 15/2/2027	1.008.394	0,04
USD 643.000	Iron Mountain Information Management Services 5% 15/7/2032	556.283	0,02	USD 637.000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	655.129	0,02
USD 1.107.000	ITT 6,5% 1/8/2029	1.005.698	0,04	USD 624.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	377.678	0,01
USD 2.000.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-NINE 2,949% 6/9/2038	1.687.608	0,06	USD 237.000	Lithia Motors 3,875% 1/6/2029	203.738	0,01
USD 533.000	Jefferies Finance / JFIN Co-Issuer 5% 15/8/2028	457.438	0,02	USD 291.000	Live Nation Entertainment 3,75% 15/1/2028	259.822	0,01
USD 26.000	JELD-WEN 4,625% 15/12/2025	25.184	0,00	USD 2.693.000	Live Nation Entertainment 4,75% 15/10/2027	2.501.357	0,09
USD 260.000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CH1 6,229% 25/7/2036	219.364	0,01	USD 54.000	Live Nation Entertainment 4,875% 1/11/2024	53.081	0,00
USD 3.295.000	JPMorgan Chase 6,626% 15/5/2047	2.813.404	0,10	USD 1.987.000	Live Nation Entertainment 6,5% 15/5/2027	1.989.770	0,07
USD 112.000	K Hovnanian Enterprises 7,75% 15/2/2026	110.954	0,00	USD 9.276.745	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 5,729% 25/7/2036	3.703.381	0,13
USD 655.000	Kaiser Aluminum 4,5% 1/6/2031	529.254	0,02	USD 557.555	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 5,739% 25/8/2036	293.092	0,01
USD 814.000	Kaiser Aluminum 4,625% 1/3/2028	718.022	0,03	USD 6.972.948	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 5,749% 25/8/2036	2.787.362	0,10
USD 160.000	KB Home 7,25% 15/7/2030	161.368	0,01	USD 6.972.949	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 5,909% 25/8/2036	2.789.045	0,10

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 4.935.521	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 5,749% 25/10/2036	1.494.669	0,05	USD 1.584.000	Nabors Industries 7,375% 15/5/2027	1.550.340	0,06
USD 1.630.009	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-WL3 6,029% 25/1/2036	1.451.055	0,05	USD 205.000	Nationstar Mortgage 5,125% 15/12/2030	173.188	0,01
USD 335.000	LSF11 A5 HoldCo 6,625% 15/10/2029	279.731	0,01	USD 333.000	Nationstar Mortgage 5,75% 15/11/2031	285.903	0,01
USD 706.000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	441.917	0,01	USD 322.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	306.998	0,01
USD 1.712.000	Madison IAQ 5,875% 30/6/2029	1.442.305	0,05	USD 570.000	Navient 5,5% 15/3/2029	487.925	0,02
USD 131.000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	127.093	0,00	USD 165.000	Navient 6,125% 25/3/2024	164.349	0,01
USD 632.000	MajorDrive IV 6,375% 1/6/2029	518.581	0,02	USD 390.000	Navient 9,375% 25/7/2030	391.127	0,01
USD 2.989.148	Mastr Asset Backed Trust 2006-FRE2 5,729% 25/3/2036	1.763.895	0,06	USD 333.000	NCR 5% 1/10/2028	305.823	0,01
USD 1.156.000	Matador Resources 5,875% 15/9/2026	1.128.180	0,04	USD 554.000	NCR 5,125% 15/4/2029	503.831	0,02
USD 627.000	Matador Resources 6,875% 15/4/2028	627.763	0,02	USD 77.000	NCR 5,75% 1/9/2027	77.834	0,00
USD 134.000	Match II 3,625% 1/10/2031	108.996	0,00	USD 874.000	NCR 6,125% 1/9/2029	899.961	0,03
USD 684.000	Match II 4,625% 1/6/2028	630.812	0,02	USD 800.000	Neptune Bidco US 9,29% 15/4/2029	745.930	0,03
USD 628.000	Match II 5,625% 15/2/2029	592.678	0,02	USD 1.021.000	NESCO II 5,5% 15/4/2029	928.104	0,03
USD 319.000	Mattel 5,45% 1/11/2041	275.010	0,01	USD 782.000	New Enterprise Stone & Lime 5,25% 15/7/2028	722.214	0,03
USD 492.000	Mattel 6,2% 1/10/2040	460.064	0,02	USD 244.000	New Enterprise Stone & Lime 9,75% 15/7/2028	242.119	0,01
USD 8.205.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	8.070.693	0,28	USD 2.201.000	New Fortress Energy 6,5% 30/9/2026	2.046.982	0,07
USD 220.000	Mauser Packaging Solutions 9,25% 15/4/2027	199.756	0,01	USD 123.000	New Fortress Energy 6,75% 15/9/2025	119.020	0,00
USD 4.009.000	McAfee 7,375% 15/2/2030	3.511.811	0,12	USD 4.673.000	NextEra Energy Capital 3,8% 15/3/2082	3.944.706	0,14
USD 94.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	81.918	0,00	USD 3.241.000	NFP 4,875% 15/8/2028	2.896.517	0,10
USD 5.392.000	Medline Borrower 5,25% 1/10/2029	4.801.382	0,17	USD 4.774.000	NFP 6,875% 15/8/2028*	4.206.768	0,15
USD 167.000	Metis Merger Sub 6,5% 15/5/2029	145.381	0,00	USD 579.000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7,5% 1/2/2026	575.324	0,02
USD 2.350.000	MetLife 3,85% 15/9/2025	2.172.811	0,08	USD 339.000	NMG / Neiman Marcus 7,125% 1/4/2026	322.364	0,01
USD 381.000	MGIC Investment 5,25% 15/8/2028	363.639	0,01	USD 793.000	Noble Finance II 8% 15/4/2030	820.872	0,03
USD 1.442.000	MicroStrategy 6,125% 15/6/2028*	1.291.845	0,05	USD 2.340.000	Northern Oil and Gas 8,125% 1/3/2028	2.347.746	0,08
USD 502.000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4,875% 1/5/2029	437.203	0,02	USD 835.000	Northern Oil and Gas 8,75% 15/6/2031	853.567	0,03
USD 623.729	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6,5% 20/6/2027	622.024	0,02	USD 2.332.000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4,75% 30/4/2027	2.035.427	0,07
USD 278.000	Minerals Technologies 5% 1/7/2028	254.305	0,01	USD 2.215.000	Novelis 3,25% 15/11/2026	2.010.324	0,07
USD 663.000	ModivCare 5,875% 15/11/2025	629.757	0,02	USD 1.836.000	Novelis 3,875% 15/8/2031	1.522.140	0,05
USD 790.000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2,73% 15/12/2050	480.911	0,02	USD 2.353.000	Novelis 4,75% 30/1/2030	2.111.130	0,07
USD 1.660.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 5,013% 15/7/2051	1.341.232	0,05	USD 510.000	NRG Energy 7% 15/3/2033	503.870	0,02
USD 1.881.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	1.274.762	0,04	USD 244.000	NuStar Logistics 5,75% 1/10/2025	239.429	0,01
USD 2.720.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 8,23% 15/7/2035	2.673.937	0,09	USD 448.000	NuStar Logistics 6% 1/6/2026	439.733	0,02
USD 1.040.358	Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2014-1 6,683% 25/6/2044	1.015.338	0,04	USD 17.000	NuStar Logistics 6,375% 1/10/2030	16.379	0,00
USD 686.318	MSCG Trust 2018-SELF 7,508% 15/10/2037	671.874	0,02	USD 829.000	Occidental Petroleum 6,2% 15/3/2040	817.307	0,03
USD 47.000	Murphy Oil 5,875% 1/12/2042	39.645	0,00	USD 7.000	Occidental Petroleum 6,45% 15/9/2036	7.143	0,00
USD 1.587.000	Nabors Industries 5,75% 1/2/2025	1.557.791	0,05	USD 1.598.000	Olympus Water US 9,75% 15/11/2028*	1.611.171	0,06
				USD 392.000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	305.687	0,01
				USD 516.000	OneMain Finance 5,375% 15/11/2029	448.889	0,02
				USD 778.000	OneMain Finance 6,625% 15/1/2028	729.097	0,03
				USD 727.000	OneMain Finance 6,875% 15/3/2025	724.133	0,03
				USD 308.000	OneMain Finance 7,125% 15/3/2026	303.596	0,01
				USD 76.000	OneMain Finance 9% 15/1/2029	77.077	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 764.000	Option Care Health 4,375% 31/10/2029	672.988	0,02	USD 184.000	RegionalCare Hospital Partners / LifePoint Health 9,75% 1/12/2026	171.632	0,01
USD 2.490.972	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5,866% 25/1/2037	2.052.335	0,07	USD 185.824	Renaissance Home Equity Loan Trust 2005-1 6,089% 25/5/2035	164.366	0,01
USD 3.870.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5,125% 30/4/2031*	3.300.764	0,12	USD 503.960	Renaissance Home Equity Loan Trust 2005-3 5,14% 25/11/2035	493.285	0,02
USD 288.000	OT Merger 7,875% 15/10/2029	190.853	0,01	USD 163.000	Resideo Funding 4% 1/9/2029	136.464	0,01
USD 174.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,25% 15/1/2029	142.901	0,01	USD 525.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,5% 15/2/2029	459.759	0,02
USD 115.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	93.581	0,00	USD 2.778.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	2.579.298	0,09
USD 1.768.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	1.601.897	0,06	USD 244.000	RLJ Lodging Trust 4% 15/9/2029	204.338	0,01
USD 938.000	Paramount Global 6,375% 30/3/2062	775.867	0,03	USD 1.337.000	Rockcliff Energy II 5,5% 15/10/2029	1.232.664	0,04
USD 1.053.000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4,5% 15/8/2028	961.522	0,03	USD 595.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	529.401	0,02
USD 352.000	PBF / PBF Finance 7,875% 15/9/2030	351.467	0,01	USD 305.000	Roller Bearing of America 4,375% 15/10/2029	271.160	0,01
USD 1.308.000	Performance Food 4,25% 1/8/2029	1.153.009	0,04	USD 441.000	Ryan Specialty 4,375% 1/2/2030	394.943	0,01
USD 2.227.000	Permian Resources Operating 5,875% 1/7/2029	2.155.189	0,08	USD 849.000	Sabre GBLB 7,375% 1/9/2025	835.340	0,03
USD 848.000	Permian Resources Operating 6,875% 1/4/2027	843.290	0,03	USD 86.000	Sabre GBLB 9,25% 15/4/2025	84.806	0,00
USD 384.000	Permian Resources Operating 7,75% 15/2/2026	388.332	0,01	USD 200.000	Sasol Financing USA 4,375% 18/9/2026	179.231	0,01
USD 2.607.000	PetSmart / PetSmart Finance 7,75% 15/2/2029	2.492.136	0,09	USD 400.000	Sasol Financing USA 6,5% 27/9/2028	363.102	0,01
USD 3.900.000	PNC Financial Services 3,4% 15/9/2026	2.964.210	0,11	USD 1.280.000	Sasol Financing USA 8,75% 3/5/2029	1.256.000	0,04
USD 141.000	Post 4,5% 15/9/2031	121.271	0,00	USD 475.000	SBA Communications 3,125% 1/2/2029	406.370	0,01
USD 48.000	Post 4,625% 15/4/2030	42.567	0,00	USD 616.000	Science Applications International 4,875% 1/4/2028	567.739	0,02
USD 109.000	Post 5,5% 15/12/2029	101.209	0,00	USD 270.000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6,625% 1/3/2030	238.248	0,01
USD 261.000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5,625% 1/9/2029	203.990	0,01	USD 831.000	SCIL IV / SCIL USA 5,375% 1/11/2026	782.795	0,03
USD 261.000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5,875% 1/9/2031	197.029	0,01	USD 1.728.257	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 3,326% 25/5/2057	664.003	0,02
USD 80.000	Presidio 4,875% 1/2/2027	74.819	0,00	USD 391.000	Service Properties Trust 7,5% 15/9/2025	388.236	0,01
USD 100.000	Prime Healthcare Services 7,25% 1/11/2025	93.804	0,00	USD 2.182.000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4,625% 1/11/2026	2.042.177	0,07
USD 83.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5,75% 15/4/2026	81.558	0,00	USD 409.000	SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	309.065	0,01
USD 2.850.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6,25% 15/1/2028	2.725.420	0,10	USD 77.000	Simmons Foods/Simmons Prepared Foods/Simmons Pet Food 4,625% 1/3/2029	63.988	0,00
USD 1.500.000	Progress Residential 2019-SFR4 Trust 3,435% 17/10/2036	1.435.424	0,05	USD 2.276.000	Sinclair Television 4,125% 1/12/2030	1.468.459	0,05
USD 1.258.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4,5% 15/9/2026*	982.743	0,04	USD 3.300.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	3.047.254	0,10
USD 3.635.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6,5% 15/9/2028	1.966.936	0,07	USD 1.070.000	Six Flags Entertainment 7,25% 15/5/2031	1.028.833	0,04
USD 359.000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4,875% 1/11/2026	336.876	0,01	USD 705.000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	705.456	0,03
USD 4.992.901	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7,867% 25/10/2039	4.996.379	0,18	USD 312.000	SM Energy 5,625% 1/6/2025	307.307	0,01
USD 20.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,25% 15/4/2030	14.082	0,00	USD 673.000	SM Energy 6,5% 15/7/2028	656.781	0,02
USD 35.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,75% 15/1/2029	25.370	0,00	USD 55.000	SM Energy 6,625% 15/1/2027	54.594	0,00
				USD 423.000	SM Energy 6,75% 15/9/2026	421.067	0,02
				USD 3.406.000	Smyrna Ready Mix Concrete 6% 1/11/2028	3.269.380	0,12
				USD 2.883.000	Sotheby's 7,375% 15/10/2027*	2.625.778	0,09

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 3.286.000	Sotheby's/Bidfair 5,875% 1/6/2029	2.541.468	0,09	USD 24.000	Taylor Morrison Communities 5,125% 1/8/2030	22.048	0,00
USD 11.000	Southwestern Energy 4,75% 1/2/2032	9.767	0,00	USD 82.000	TEGNA 4,75% 15/3/2026	78.199	0,00
USD 1.157.000	Southwestern Energy 5,375% 1/2/2029	1.099.458	0,04	USD 155.000	Tempo Acquisition / Tempo Acquisition Finance 5,75% 1/6/2025	152.522	0,01
USD 329.000	Specialty Building Products / SBP Finance 6,375% 30/9/2026	312.969	0,01	USD 1.684.000	Tenet Healthcare 4,875% 1/1/2026	1.633.741	0,06
USD 581.000	Spectrum Brands 5% 1/10/2029	531.817	0,02	USD 1.239.000	Tenet Healthcare 5,125% 1/11/2027	1.181.149	0,04
USD 161.000	Spectrum Brands 5,5% 15/7/2030	149.563	0,01	USD 809.000	Tenet Healthcare 6,125% 1/10/2028	779.605	0,03
USD 168.000	Spirit AeroSystems 7,5% 15/4/2025	166.019	0,01	USD 952.000	Tenet Healthcare 6,25% 1/2/2027	939.111	0,03
USD 1.262.000	Spirit AeroSystems 9,375% 30/11/2029	1.314.473	0,04	USD 285.000	Tenet Healthcare 6,75% 15/5/2031	284.352	0,01
USD 3.272.000	SRS Distribution 4,625% 1/7/2028	2.918.644	0,10	USD 386.000	Tenneco 8% 17/11/2028	317.624	0,01
USD 3.419.000	SRS Distribution 6% 1/12/2029	2.926.903	0,10	USD 1.253.000	Terex 5% 15/5/2029	1.151.601	0,04
USD 1.725.000	SRS Distribution 6,125% 1/7/2029	1.500.849	0,05	USD 129.000	Titan International 7% 30/4/2028	122.959	0,00
USD 227.000	Stagwell Global 5,625% 15/8/2029	189.896	0,01	USD 4.731.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	4.457.234	0,16
USD 123.000	Standard Industries 3,375% 15/1/2031	97.824	0,00	USD 128.000	Tri Pointe Homes 5,7% 15/6/2028	121.121	0,00
USD 239.000	Standard Industries 4,375% 15/7/2030	203.724	0,01	USD 220.000	Trident TPI 12,75% 31/12/2028	229.128	0,01
USD 1.016.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	936.627	0,03	USD 1.976.000	Triumph 9% 15/3/2028	1.983.552	0,07
USD 804.000	Staples 7,5% 15/4/2026	667.085	0,02	USD 381.000	TTMT Escrow Issuer 8,625% 30/9/2027	393.133	0,01
USD 115.000	Starwood Property Trust 4,375% 15/1/2027	103.165	0,00	USD 481.000	Twilio 3,625% 15/3/2029	413.482	0,01
USD 8.457.000	State Street 6,552% 15/6/2047	6.910.180	0,24	USD 4.224.000	Uber Technologies 4,5% 15/8/2029	3.877.839	0,14
USD 314.000	Station Casinos 4,5% 15/2/2028	281.016	0,01	USD 940.000	Uber Technologies 6,25% 15/1/2028	931.545	0,03
USD 899.000	Station Casinos 4,625% 1/12/2031	737.811	0,03	USD 2.280.000	Uber Technologies 7,5% 15/9/2027	2.324.082	0,08
USD 78.160	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006- AR6 5,809% 25/7/2046	55.154	0,00	USD 1.599.000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	1.629.275	0,06
USD 165.000	Suburban Propane Partners/ Suburban Energy Finance 5% 1/6/2031	141.288	0,01	USD 1.646.000	United Airlines 4,375% 15/4/2026	1.550.780	0,05
USD 84.000	Summit Materials / Summit Materials Finance 5,25% 15/1/2029	78.120	0,00	USD 3.348.000	United Airlines 4,625% 15/4/2029	2.981.118	0,11
USD 28.000	Sunoco / Sunoco Finance 6% 15/4/2027	27.731	0,00	USD 361.902	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027	361.430	0,01
USD 2.767.000	Surgery Center 6,75% 1/7/2025*	2.767.125	0,10	USD 61.417	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026	59.114	0,00
USD 476.000	Surgery Center 10% 15/4/2027	484.782	0,02	USD 168.000	United Natural Foods 6,75% 15/10/2028	140.033	0,00
USD 926.000	SWF Escrow Issuer 6,5% 1/10/2029	597.520	0,02	USD 859.000	United States Treasury Bill 0% 14/11/2023	849.701	0,03
USD 1.197.000	Synaptics 4% 15/6/2029	1.014.722	0,04	USD 1.766.000	Unifi Group / Unifi Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	1.760.178	0,06
USD 278.000	Talen Energy Supply 8,625% 1/6/2030	289.479	0,01	USD 981.000	Univision Communications 5,125% 15/2/2025*	965.148	0,03
USD 108.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	103.352	0,00	USD 792.000	Univision Communications 6,625% 1/6/2027	769.081	0,03
USD 74.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 31/12/2030	66.370	0,00	USD 262.000	Univision Communications 7,375% 30/6/2030*	254.655	0,01
USD 359.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/9/2031	317.266	0,01	USD 922.000	Univision Communications 8% 15/8/2028	923.363	0,03
USD 19.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7,5% 1/10/2025	19.047	0,00	USD 2.680.000	US Bancorp 3,7% 15/1/2027	2.016.700	0,07
				USD 1.185.000	US Foods 4,625% 1/6/2030	1.053.879	0,04
				USD 533.000	US Foods 4,75% 15/2/2029	486.325	0,02
				USD 1.280.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/4/2026	1.267.732	0,05

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 53.600	Bank of Montreal (Fund receives 33,46% Fixed; and receives/pays return on Newell Brands) (19/10/2023)	568.633	0,02	USD 4.054	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,95% Fixed; and receives/pays return on Parker-Hannifin) (26/9/2023)	1.709.376	0,06
USD 167.531	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,12% Fixed; and receives/pays return on AT&T) (15/9/2023)	2.485.554	0,09	USD 10.124	Royal Bank of Canada (Fund receives 15,51% Fixed; and receives/pays return on Cigna) (26/9/2023)	2.862.345	0,10
USD 6.540	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,37% Fixed; and receives/pays return on Thermo Fisher Scientific) (15/9/2023)	3.690.393	0,13	USD 45.500	Royal Bank of Canada (Fund receives 15,6% Fixed; and receives/pays return on PG&E) (28/9/2023)	760.322	0,03
USD 8.700	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,77% Fixed; and receives/pays return on Sempra) (30/10/2023)	623.877	0,02	USD 8.400	Royal Bank of Canada (Fund receives 16,05% Fixed; and receives/pays return on Public Service Enterprise) (2/10/2023)	515.363	0,02
EUR 31.765	Royal Bank of Canada (Fund receives 11,23% Fixed; and receives/pays return on Publicis Groupe) (14/9/2023)	2.495.942	0,09	USD 21.072	Royal Bank of Canada (Fund receives 16,31% Fixed; and receives/pays return on ConocoPhillips) (26/9/2023)	2.494.869	0,09
USD 35.838	Royal Bank of Canada (Fund receives 11,55% Fixed; and receives/pays return on Starbucks) (25/9/2023)	3.574.480	0,13	USD 31.946	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,03% Fixed; and receives/pays return on Walt Disney) (28/9/2023)	2.729.136	0,10
USD 23.306	Royal Bank of Canada (Fund receives 12,75% Fixed; and receives/pays return on American Electric Power) (18/9/2023)	1.864.101	0,07	EUR 92.533	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,38% Fixed; and receives/pays return on Koninklijke Philips) (14/9/2023)	2.031.393	0,07
USD 16.543	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,05% Fixed; and receives/pays return on Hilton Worldwide) (15/9/2023)	2.491.753	0,09	USD 34.559	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,55% Fixed; and receives/pays return on Borgwarner) (25/9/2023)	1.427.328	0,05
USD 3.395	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,1% Fixed; and receives/pays return on Everest) (28/9/2023)	1.226.910	0,04	USD 19.713	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,6% Fixed; and receives/pays return on Meta Platforms) (18/9/2023)	5.934.026	0,21
USD 54.562	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,19% Fixed; and receives/pays return on Flex) (18/9/2023)	1.512.975	0,05	USD 33.599	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,2% Fixed; and receives/pays return on Fidelity National Information Services) (25/9/2023)	1.899.796	0,07
USD 6.610	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,61% Fixed; and receives/pays return on Servicenow) (18/9/2023)	3.878.665	0,14	USD 12.645	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,2% Fixed; and receives/pays return on LyondellBasell Industries) (27/9/2023)	1.251.810	0,04
USD 76.701	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,17% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (15/9/2023)	10.315.043	0,36	USD 19.737	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,39% Fixed; and receives/pays return on Valero Energy) (18/9/2023)	2.555.561	0,09
USD 777	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,39% Fixed; and receives/pays return on Booking) (27/9/2023)	2.422.996	0,09	USD 2.771	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,89% Fixed; and receives/pays return on United Rentals) (18/9/2023)	1.296.668	0,05
USD 16.991	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,52% Fixed; and receives/pays return on Ebay) (18/9/2023)	759.844	0,03	USD 27.300	Royal Bank of Canada (Fund receives 19,19% Fixed; and receives/pays return on Exelon) (14/9/2023)	1.100.465	0,04
USD 50.100	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,71% Fixed; and receives/pays return on Fidelity National Financial) (30/10/2023)	2.047.422	0,07	USD 13.986	Royal Bank of Canada (Fund receives 20,12% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	1.942.752	0,07
USD 13.410	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,92% Fixed; and receives/pays return on Hess) (15/9/2023)	2.058.647	0,07	USD 139.700	Royal Bank of Canada (Fund receives 20,6% Fixed; and receives/pays return on Kosmos Energy) (30/10/2023)	1.025.887	0,04

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 57.100	Royal Bank of Canada (Fund receives 21,44% Fixed; and receives/pays return on Baxter International) (19/10/2023)	2.421.143	0,08	USD 131.856	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,57% Fixed; and receives/pays return on BP) (29/9/2023)	4.911.796	0,17
GBP 7.500	Royal Bank of Canada (Fund receives 21,89% Fixed; and receives/pays return on Astrazeneca) (21/9/2023)	989.188	0,03	USD 28.757	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,6% Fixed; and receives/pays return on Paccar) (14/9/2023)	2.390.275	0,08
USD 3.100	Royal Bank of Canada (Fund receives 25,46% Fixed; and receives/pays return on Ralph Lauren) (19/10/2023)	368.621	0,01	USD 51.562	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,8% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (27/10/2023)	2.412.070	0,09
USD 34.400	Royal Bank of Canada (Fund receives 26,04% Fixed; and receives/pays return on Equitable) (19/10/2023)	995.426	0,03	USD 7.542	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 11,37% Fixed; and receives/pays return on Vulcan Materials) (26/9/2023)	1.651.220	0,06
EUR 33.300	Royal Bank of Canada (Fund receives 26,81% Fixed; and receives/pays return on Koninklijke Philips) (5/10/2023)	714.079	0,02	USD 19.438	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 12,02% Fixed; and receives/pays return on Johnson Controls International) (25/9/2023)	1.157.862	0,04
EUR 40.224	Royal Bank of Canada (Fund receives 5,87% Fixed; and receives/pays return on Danone) (20/9/2023)	2.374.685	0,08	USD 30.684	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 13,62% Fixed; and receives/pays return on Gilead Sciences) (27/9/2023)	2.346.439	0,08
USD 20.700	Royal Bank of Canada (Fund receives 6,77% Fixed; and receives/pays return on Unilever) (30/10/2023)	1.062.117	0,04	USD 18.441	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 14,52% Fixed; and receives/pays return on Dow) (14/9/2023)	1.010.515	0,04
USD 23.357	Royal Bank of Canada (Fund receives 7,29% Fixed; and receives/pays return on Fiserv) (15/9/2023)	2.864.405	0,10	USD 9.832	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 16% Fixed; and receives/pays return on Marathon Petroleum) (29/9/2023)	1.400.669	0,05
USD 7.293	Royal Bank of Canada (Fund receives 8,87% Fixed; and receives/pays return on Becton Dickinson) (26/9/2023)	2.017.103	0,07	USD 48.400	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 19,41% Fixed; and receives/pays return on Sealed Air) (8/9/2023)	1.805.002	0,06
USD 27.344	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,03% Fixed; and receives/pays return on Otis Worldwide) (15/9/2023)	2.375.042	0,08	USD 700	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 19,51% Fixed; and receives/pays return on Humana) (14/9/2023)	311.050	0,01
USD 6.772	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,31% Fixed; and receives/pays return on McKesson) (26/9/2023)	2.854.706	0,10	USD 41.700	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 21,11% Fixed; and receives/pays return on Cognizant Technology Solutions) (12/10/2023)	2.835.859	0,10
USD 11.781	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,48% Fixed; and receives/pays return on Automatic Data Processing) (15/9/2023)	3.010.442	0,11	USD 9.700	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 23,2% Fixed; and receives/pays return on Lear) (12/10/2023)	1.429.314	0,05
USD 5.139	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,49% Fixed; and receives/pays return on Humana) (25/9/2023)	2.435.943	0,09	USD 42.400	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 26,46% Fixed; and receives/pays return on Carlyle) (19/10/2023)	1.415.009	0,05
USD 65.800	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,71% Fixed; and receives/pays return on Apple) (27/9/2023)	12.378.418	0,44	USD 14.994	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 6,7% Fixed; and receives/pays return on Waste Management) (15/9/2023)	2.366.058	0,08
USD 85.144	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,15% Fixed; and receives/pays return on Wells Fargo) (16/10/2023)	3.576.048	0,13	USD 24.987	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 6,73% Fixed; and receives/pays return on AbbVie) (18/9/2023)	3.719.474	0,13
USD 40.403	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,4% Fixed; and receives/pays return on JPMorgan Chase) (16/10/2023)	6.010.350	0,21	USD 38.508	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,36% Fixed; and receives/pays return on Nasdaq) (11/9/2023)	2.027.179	0,07

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 82.093	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,51% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (18/9/2023)	3.831.678	0,14	USD 28.400	Societe Generale (Fund receives 0,7233% Fixed; and receives/pays return on Fidelity National Information Services) (2/11/2023)	1.595.766	0,06
USD 10.827	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,52% Fixed; and receives/pays return on YUM! Brands) (25/9/2023)	1.417.430	0,05	USD 3.000	Societe Generale (Fund receives 0,794% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (2/11/2023)	402.960	0,01
USD 984	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,7% Fixed; and receives/pays return on Autozone) (19/9/2023)	2.486.032	0,09	USD 10.507	Societe Generale (Fund receives 0,8533% Fixed; and receives/pays return on Arista Networks) (21/9/2023)	2.023.888	0,07
USD 9.018	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,97% Fixed; and receives/pays return on HCA Healthcare) (18/9/2023)	2.521.876	0,09	USD 1.200	Societe Generale (Fund receives 0,9042% Fixed; and receives/pays return on Meta Platforms) (2/11/2023)	355.888	0,01
USD 5.717	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,98% Fixed; and receives/pays return on Costco Wholesale) (22/9/2023)	3.022.140	0,11	USD 66.450	Societe Generale (Fund receives 0,9047% Fixed; and receives/pays return on Ally Financial) (11/9/2023)	1.850.312	0,07
USD 17.881	BNP Paribas (Fund receives 14,45% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/10/2023)	2.412.326	0,09	USD 61.283	Societe Generale (Fund receives 0,9963% Fixed; and receives/pays return on Mosaic) (25/9/2023)	2.420.550	0,09
USD 13.248	Societe Generale (Fund receives 0,2437% Fixed; and receives/pays return on Zimmer Biomet) (21/9/2023)	1.601.383	0,06	USD 23.982	Societe Generale (Fund receives 1,062% Fixed; and receives/pays return on Citizens Financial) (11/9/2023)	680.095	0,02
USD 10.461	Societe Generale (Fund receives 0,382% Fixed; and receives/pays return on AmerisourceBergen) (25/9/2023)	1.870.954	0,07	USD 31.783	BNP Paribas (Fund receives 10,76% Fixed; and receives/pays return on UnitedHealth) (16/10/2023)	15.663.616	0,55
USD 6.826	Societe Generale (Fund receives 0,3827% Fixed; and receives/pays return on Ecolab) (21/9/2023)	1.260.884	0,04	USD 57.621	BNP Paribas (Fund receives 11,3% Fixed; and receives/pays return on Citigroup) (16/10/2023)	2.403.948	0,09
USD 14.700	Societe Generale (Fund receives 0,4643% Fixed; and receives/pays return on Zimmer Biomet) (2/10/2023)	1.780.136	0,06	USD 9.711	BNP Paribas (Fund receives 11,98% Fixed; and receives/pays return on Marriott International) (21/9/2023)	1.997.299	0,07
USD 22.600	Societe Generale (Fund receives 0,526% Fixed; and receives/pays return on Leidos) (2/11/2023)	2.192.788	0,08	USD 25.684	BNP Paribas (Fund receives 12,46% Fixed; and receives/pays return on Kellogg) (26/9/2023)	1.580.122	0,06
USD 34.673	Societe Generale (Fund receives 0,55% Fixed; and receives/pays return on Kraft Heinz) (25/9/2023)	1.158.955	0,04	USD 19.537	BNP Paribas (Fund receives 12,81% Fixed; and receives/pays return on Occidental Petroleum) (26/9/2023)	1.222.270	0,04
USD 10.521	Societe Generale (Fund receives 0,6017% Fixed; and receives/pays return on Elevance Health) (11/9/2023)	4.808.100	0,17	USD 1.585	BNP Paribas (Fund receives 13,12% Fixed; and receives/pays return on Equinix) (26/9/2023)	1.237.108	0,04
USD 54.820	Societe Generale (Fund receives 0,6387% Fixed; and receives/pays return on Synchrony Financial) (11/9/2023)	1.788.174	0,06	EUR 33.725	BNP Paribas (Fund receives 13,31% Fixed; and receives/pays return on Randstad) (20/9/2023)	1.983.396	0,07
USD 2.600	Societe Generale (Fund receives 0,6723% Fixed; and receives/pays return on Elevance Health) (2/10/2023)	1.193.051	0,04	USD 149.751	BNP Paribas (Fund receives 13,67% Fixed; and receives/pays return on Ford Motor) (19/9/2023)	1.827.294	0,06
USD 25.400	Societe Generale (Fund receives 0,683% Fixed; and receives/pays return on Fox) (2/11/2023)	849.182	0,03	USD 16.884	BNP Paribas (Fund receives 14,07% Fixed; and receives/pays return on Voya Financial) (28/9/2023)	1.205.329	0,04
				USD 27.072	BNP Paribas (Fund receives 15,04% Fixed; and receives/pays return on MGM Resorts International) (26/9/2023)	1.199.677	0,04

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 18.553	BNP Paribas (Fund receives 15,22% Fixed; and receives/pays return on Molson Coors Beverage) (21/9/2023)	1.179.408	0,04	USD 13.027	BNP Paribas (Fund receives 9,95% Fixed; and receives/pays return on Zoetis) (27/9/2023)	2.492.290	0,09
USD 34.273	BNP Paribas (Fund receives 15,34% Fixed; and receives/pays return on Delta Air Lines) (13/10/2023)	1.456.406	0,05	EUR 18.402	BNP Paribas (Fund receives 9,98% Fixed; and receives/pays return on Essilorluxottica) (20/9/2023)	3.526.392	0,12
USD 30.777	BNP Paribas (Fund receives 15,35% Fixed; and receives/pays return on Best Buy) (22/11/2023)	2.367.675	0,08	USD 17.744	JP Morgan (Fund receives 13,92% Fixed; and receives/pays return on NextEra Energy) (27/10/2023)	1.206.894	0,04
USD 7.529	BNP Paribas (Fund receives 16,01% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (27/9/2023)	2.468.944	0,09	USD 43.364	JP Morgan (Fund receives 15,96% Fixed; and receives/pays return on Bank of America) (1/9/2023)	1.259.104	0,04
EUR 7.300	BNP Paribas (Fund receives 16,38% Fixed; and receives/pays return on Danone) (21/9/2023)	430.711	0,02	USD 17.176	JP Morgan (Fund receives 16,57% Fixed; and receives/pays return on Las Vegas Sands) (12/9/2023)	955.557	0,03
USD 4.186	BNP Paribas (Fund receives 16,89% Fixed; and receives/pays return on Palo Alto Networks) (17/11/2023)	986.258	0,03	USD 5.200	JP Morgan (Fund receives 16,72% Fixed; and receives/pays return on Willis Towers Watson) (28/9/2023)	1.101.928	0,04
USD 25.543	BNP Paribas (Fund receives 18,83% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	3.535.378	0,12	USD 3.300	JP Morgan (Fund receives 17,15% Fixed; and receives/pays return on Robert Half International) (28/9/2023)	251.971	0,01
EUR 9.000	BNP Paribas (Fund receives 20,16% Fixed; and receives/pays return on Airbus) (21/9/2023)	1.280.522	0,05	USD 2.409	JP Morgan (Fund receives 17,49% Fixed; and receives/pays return on ServiceNow) (1/9/2023)	1.314.456	0,05
USD 1.300	BNP Paribas (Fund receives 20,26% Fixed; and receives/pays return on First Citizens BancShares) (26/10/2023)	1.794.781	0,06	USD 28.886	JP Morgan (Fund receives 17,51% Fixed; and receives/pays return on Fortinet) (2/11/2023)	1.731.798	0,06
USD 23.307	BNP Paribas (Fund receives 21,12% Fixed; and receives/pays return on Voya Financial) (28/9/2023)	2.339.825	0,08	USD 12.541	JP Morgan (Fund receives 17,52% Fixed; and receives/pays return on Phillips 66) (29/9/2023)	1.435.927	0,05
EUR 2.600	BNP Paribas (Fund receives 22,91% Fixed; and receives/pays return on Siemens) (21/9/2023)	396.258	0,01	USD 10.300	JP Morgan (Fund receives 17,9% Fixed; and receives/pays return on Sony) (8/9/2023)	860.016	0,03
GBP 71.500	BNP Paribas (Fund receives 23,72% Fixed; and receives/pays return on Shell) (21/9/2023)	2.134.844	0,08	USD 56.385	JP Morgan (Fund receives 18,24% Fixed; and receives/pays return on American Airlines) (12/9/2023)	837.746	0,03
USD 19.359	BNP Paribas (Fund receives 27,09% Fixed; and receives/pays return on Comerica) (13/9/2023)	929.882	0,03	USD 1.100	JP Morgan (Fund receives 18,49% Fixed; and receives/pays return on Eli Lilly) (26/10/2023)	603.459	0,02
USD 12.539	BNP Paribas (Fund receives 6,2% Fixed; and receives/pays return on McDonald's) (18/9/2023)	3.556.659	0,13	USD 17.408	JP Morgan (Fund receives 18,51% Fixed; and receives/pays return on United Airlines) (12/9/2023)	874.596	0,03
USD 8.545	BNP Paribas (Fund receives 8,1% Fixed; and receives/pays return on Stryker) (27/9/2023)	2.466.047	0,09	USD 3.700	JP Morgan (Fund receives 19,12% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (26/10/2023)	1.214.358	0,04
USD 48.834	BNP Paribas (Fund receives 8,37% Fixed; and receives/pays return on CVS Health) (25/9/2023)	3.259.713	0,12	USD 37.200	JP Morgan (Fund receives 19,93% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (26/10/2023)	1.756.641	0,06
USD 386	BNP Paribas (Fund receives 9,26% Fixed; and receives/pays return on Chipotle Mexican Grill) (18/9/2023)	746.726	0,03	USD 45.100	JP Morgan (Fund receives 21,12% Fixed; and receives/pays return on Citigroup) (26/10/2023)	1.903.272	0,07

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 6.000	JP Morgan (Fund receives 21,33% Fixed; and receives/pays return on ConocoPhillips) (26/10/2023)	707.006	0,03	USD 56.284	Barclays (Fund receives 16,67% Fixed; and receives/pays return on Baker Hughes) (11/9/2023)	2.029.048	0,07
USD 8.298	JP Morgan (Fund receives 21,77% Fixed; and receives/pays return on Meta Platforms) (26/10/2023)	2.443.521	0,09	USD 17.687	Barclays (Fund receives 18,02% Fixed; and receives/pays return on Schlumberger) (13/9/2023)	1.027.382	0,04
USD 26.900	JP Morgan (Fund receives 22,47% Fixed; and receives/pays return on Medtronic) (2/10/2023)	2.226.973	0,08	USD 6.302	Barclays (Fund receives 18,9% Fixed; and receives/pays return on Autonation) (13/9/2023)	999.829	0,04
USD 27.071	JP Morgan (Fund receives 5,29% Fixed; and receives/pays return on TJX) (29/9/2023)	2.485.631	0,09	GBP 104.700	Barclays (Fund receives 19,38% Fixed; and receives/pays return on BAE Systems) (21/9/2023)	1.208.643	0,04
USD 10.704	JP Morgan (Fund receives 6,14% Fixed; and receives/pays return on Walmart) (17/11/2023)	1.701.915	0,06	EUR 25.500	Barclays (Fund receives 20,9% Fixed; and receives/pays return on Bayer) (5/10/2023)	1.416.373	0,05
USD 10.518	JP Morgan (Fund receives 6,93% Fixed; and receives/pays return on Marsh & McLennan) (12/9/2023)	2.052.353	0,07	USD 10.300	Barclays (Fund receives 21,56% Fixed; and receives/pays return on Dollar General) (30/10/2023)	1.596.397	0,06
USD 17.465	JP Morgan (Fund receives 7,33% Fixed; and receives/pays return on T-Mobile US) (19/9/2023)	2.405.722	0,09	GBP 58.300	Barclays (Fund receives 22,6% Fixed; and receives/pays return on British American Tobacco) (5/10/2023)	1.933.564	0,07
EUR 37.576	JP Morgan (Fund receives 7,92% Fixed; and receives/pays return on SAP) (14/9/2023)	5.082.894	0,18	GBP 1.306.900	Barclays (Fund receives 25% Fixed; and receives/pays return on Vodafone) (5/10/2023)	1.222.969	0,04
USD 11.448	JP Morgan (Fund receives 9,93% Fixed; and receives/pays return on Travelers) (12/9/2023)	1.845.365	0,07	GBP 86.600	Barclays (Fund receives 26,55% Fixed; and receives/pays return on Prudential) (21/9/2023)	1.080.530	0,04
USD 30.800	UBS (Fund receives 19,9% Fixed; and receives/pays return on General Motors) (2/10/2023)	1.049.914	0,04	USD 87.554	Barclays (Fund receives 5,39% Fixed; and receives/pays return on Cisco Systems) (2/10/2023)	4.974.427	0,18
USD 40.700	UBS (Fund receives 23,3% Fixed; and receives/pays return on AT&T) (14/9/2023)	601.925	0,02	USD 15.014	Barclays (Fund receives 6,83% Fixed; and receives/pays return on Philip Morris International) (12/9/2023)	1.461.347	0,05
USD 38.499	UBS (Fund receives 6,3% Fixed; and receives/pays return on Walmart) (2/10/2023)	6.184.467	0,22	USD 12.442	Goldman Sachs (Fund receives 10,35% Fixed; and receives/pays return on Starbucks) (2/11/2023)	1.217.156	0,04
GBP 114.630	Barclays (Fund receives 10,42% Fixed; and receives/pays return on Unilever) (20/9/2023)	5.948.371	0,21	USD 46.866	Goldman Sachs (Fund receives 11,79% Fixed; and receives/pays return on Target) (29/9/2023)	5.942.611	0,21
USD 19.817	Barclays (Fund receives 11,43% Fixed; and receives/pays return on Agilent Technologies) (29/9/2023)	2.427.325	0,09	USD 17.794	Goldman Sachs (Fund receives 16,03% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/10/2023)	2.435.931	0,09
USD 3.200	Barclays (Fund receives 11,83% Fixed; and receives/pays return on Visa) (28/9/2023)	784.918	0,03	USD 2.907	Goldman Sachs (Fund receives 20,75% Fixed; and receives/pays return on Netflix) (18/10/2023)	1.225.778	0,04
USD 11.392	Barclays (Fund receives 12,28% Fixed; and receives/pays return on DTE Energy) (27/10/2023)	1.193.028	0,04	USD 2.782	Goldman Sachs (Fund receives 21,49% Fixed; and receives/pays return on Netflix) (27/9/2023)	1.215.369	0,04
USD 16.807	Barclays (Fund receives 15,09% Fixed; and receives/pays return on Sempra) (3/11/2023)	1.203.601	0,04	USD 5.598	Goldman Sachs (Fund receives 9,61% Fixed; and receives/pays return on Synopsys) (2/10/2023)	2.524.815	0,09

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 16.600	HSBC (Fund receives 16% Fixed; and receives/pays return on Sanofi) (5/10/2023)	1.765.582	0,06	USD 1.781	Citigroup (Fund receives 11,34% Fixed; and receives/pays return on O'Reilly Automotive) (26/10/2023)	1.677.988	0,06
GBP 6.500	HSBC (Fund receives 19,77% Fixed; and receives/pays return on Reckitt Benckiser) (21/9/2023)	475.077	0,02	USD 2.565	Citigroup (Fund receives 11,42% Fixed; and receives/pays return on UnitedHealth) (1/9/2023)	1.260.588	0,05
GBP 449.900	HSBC (Fund receives 24,04% Fixed; and receives/pays return on BP) (21/9/2023)	2.681.554	0,10	USD 17.359	Citigroup (Fund receives 11,85% Fixed; and receives/pays return on Caterpillar) (21/9/2023)	4.930.285	0,17
USD 28.894	Nomura (Fund receives 11,1% Fixed; and receives/pays return on Archer-Daniels-Midland) (14/9/2023)	2.319.917	0,08	USD 104.201	Citigroup (Fund receives 12,05% Fixed; and receives/pays return on Pfizer) (21/9/2023)	3.746.514	0,13
USD 72.714	Nomura (Fund receives 11,22% Fixed; and receives/pays return on Verizon Communications) (14/9/2023)	2.522.936	0,09	USD 6.830	Citigroup (Fund receives 12,65% Fixed; and receives/pays return on Eaton) (21/9/2023)	1.539.718	0,05
USD 40.092	Nomura (Fund receives 14,18% Fixed; and receives/pays return on Morgan Stanley) (8/9/2023)	3.421.736	0,12	USD 24.701	Citigroup (Fund receives 12,98% Fixed; and receives/pays return on BJ's Wholesale Club) (17/11/2023)	1.661.468	0,06
USD 37.380	Nomura (Fund receives 14,81% Fixed; and receives/pays return on Charles Schwab) (8/9/2023)	2.232.410	0,08	USD 8.811	Citigroup (Fund receives 13,09% Fixed; and receives/pays return on JP Morgan Chase) (1/9/2023)	1.286.379	0,05
USD 33.068	Nomura (Fund receives 15,64% Fixed; and receives/pays return on NextEra Energy) (14/9/2023)	2.232.836	0,08	USD 5.398	Citigroup (Fund receives 13,24% Fixed; and receives/pays return on Danaher) (1/9/2023)	1.281.869	0,05
USD 19.000	Nomura (Fund receives 18,64% Fixed; and receives/pays return on Williams) (14/9/2023)	643.927	0,02	USD 21.391	Citigroup (Fund receives 13,25% Fixed; and receives/pays return on Toll Brothers) (27/10/2023)	1.726.037	0,06
USD 63.400	Nomura (Fund receives 18,75% Fixed; and receives/pays return on Kraft Heinz) (28/9/2023)	2.115.116	0,07	USD 21.583	Citigroup (Fund receives 13,38% Fixed; and receives/pays return on Bank of New York Mellon) (8/9/2023)	967.951	0,03
USD 36.600	Nomura (Fund receives 20,86% Fixed; and receives/pays return on SS&C Technologies) (2/11/2023)	2.080.485	0,07	USD 11.187	Citigroup (Fund receives 13,49% Fixed; and receives/pays return on PNC Financial Services) (8/9/2023)	1.365.742	0,05
USD 2.300	Nomura (Fund receives 24,56% Fixed; and receives/pays return on Novo Nordisk) (14/9/2023)	359.927	0,01	USD 59.456	Citigroup (Fund receives 13,54% Fixed; and receives/pays return on Exxon Mobil) (19/9/2023)	6.477.258	0,23
USD 78.352	Nomura (Fund receives 8,64% Fixed; and receives/pays return on Shell) (29/9/2023)	4.874.976	0,17	USD 23.334	Citigroup (Fund receives 13,98% Fixed; and receives/pays return on Chevron) (19/9/2023)	3.765.057	0,13
USD 18.685	Citigroup (Fund receives 10,23% Fixed; and receives/pays return on Kimberly-Clark) (14/9/2023)	2.410.995	0,09	USD 45.903	Citigroup (Fund receives 14,15% Fixed; and receives/pays return on Flex) (26/10/2023)	1.241.726	0,04
USD 6.597	Citigroup (Fund receives 10,46% Fixed; and receives/pays return on PPG Industries) (13/9/2023)	944.726	0,03	USD 47.053	Citigroup (Fund receives 14,25% Fixed; and receives/pays return on Merck & Co) (21/9/2023)	5.117.457	0,18
USD 4.617	Citigroup (Fund receives 10,6% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (1/9/2023)	1.517.799	0,05	USD 14.789	Citigroup (Fund receives 14,35% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (15/9/2023)	4.893.158	0,17
USD 8.410	Citigroup (Fund receives 10,74% Fixed; and receives/pays return on Apple) (1/9/2023)	1.542.305	0,05	USD 199.375	Citigroup (Fund receives 14,51% Fixed; and receives/pays return on Bank of America) (8/9/2023)	5.780.139	0,20
USD 38.174	Citigroup (Fund receives 10,76% Fixed; and receives/pays return on CSX) (13/9/2023)	1.165.043	0,04				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 46.098	Citigroup (Fund receives 15,38% Fixed; and receives/pays return on General Motors) (14/9/2023)	1.554.757	0,06	USD 17.749	Citigroup (Fund receives 5% Fixed; and receives/pays return on Abbott Laboratories) (12/9/2023)	1.855.156	0,07
USD 5.720	Citigroup (Fund receives 15,67% Fixed; and receives/pays return on Nucor) (14/9/2023)	984.350	0,04	USD 4.171	Citigroup (Fund receives 6,82% Fixed; and receives/pays return on McDonald's) (1/9/2023)	1.185.390	0,04
USD 11.979	Citigroup (Fund receives 16,42% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (1/9/2023)	1.543.493	0,06	USD 19.780	Citigroup (Fund receives 8,16% Fixed; and receives/pays return on Sysco) (21/9/2023)	1.395.938	0,05
USD 12.536	Citigroup (Fund receives 16,77% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (1/9/2023)	1.576.795	0,06	USD 9.593	Citigroup (Fund receives 8,57% Fixed; and receives/pays return on Danaher) (14/9/2023)	2.544.012	0,09
USD 34.841	Citigroup (Fund receives 17,17% Fixed; and receives/pays return on Fifth Third Bancorp) (13/9/2023)	933.386	0,03	USD 5.116	Citigroup (Fund receives 9,82% Fixed; and receives/pays return on Gartner) (21/9/2023)	1.792.575	0,06
USD 56.800	Citigroup (Fund receives 19,44% Fixed; and receives/pays return on Wells Fargo) (8/9/2023)	2.366.892	0,08	Total des obligations indexées sur des actions		478.593.742	16,90
USD 5.970	Citigroup (Fund receives 20,27% Fixed; and receives/pays return on Meta Platforms) (1/9/2023)	1.569.298	0,06	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		2.720.362.860	96,07
USD 47.700	Citigroup (Fund receives 20,77% Fixed; and receives/pays return on Verizon Communications) (8/9/2023)	1.668.866	0,06	Autres titres négociables			
USD 8.300	Citigroup (Fund receives 21,06% Fixed; and receives/pays return on Raymond James Financial) (8/9/2023)	851.525	0,03	ACTIONS ORDINAIRES			
USD 29.401	Citigroup (Fund receives 21,35% Fixed; and receives/pays return on Freeport-McMoRan) (12/9/2023)	1.192.387	0,04	Chypre			
USD 65.815	Citigroup (Fund receives 22,08% Fixed; and receives/pays return on The AES) (3/11/2023)	1.198.491	0,04	270.630	Fix Price**	473.602	0,02
USD 33.700	Citigroup (Fund receives 23,43% Fixed; and receives/pays return on Citizens Financial) (8/9/2023)	945.222	0,03	16.469	TCS**	263.504	0,01
USD 56.698	Citigroup (Fund receives 24,71% Fixed; and receives/pays return on First Horizon) (11/9/2023)	718.593	0,03				
USD 5.573	Citigroup (Fund receives 25,99% Fixed; and receives/pays return on Avis Budget) (21/9/2023)	1.218.782	0,04				
				Pays-Bas			
				46.784	X5 Retail**	166.083	0,00
				Fédération de Russie			
				104.138	LUKOIL**	11	0,00
				200	Novatek**	-	0,00
				229.472	Sberbank of Russia**	24	0,00
				35			
				États-Unis			
				1.649	Sequoia Pine Investment**	784.957	0,03
				Total des actions ordinaires		1.688.181	0,06
				Total des autres valeurs mobilières		1.688.181	0,06
				Total du portefeuille		2.722.051.041	96,13
				Autres éléments de l'actif net		109.703.318	3,87
				Total de l'actif net (USD)		2.831.754.359	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	297.000	USD	202.373	HSBC Bank	16/10/2023	(9.692)
AUD	2.000	USD	1.288	Barclays	16/10/2023	9
AUD	128.000	USD	82.266	BNP Paribas	16/10/2023	775
CAD	1.496.000	USD	1.135.875	BNP Paribas	16/10/2023	(29.384)
CAD	131.000	USD	99.045	Morgan Stanley	16/10/2023	(2.152)
CHF	24.000	USD	27.554	BNP Paribas	16/10/2023	(255)
EUR	28.000	USD	30.831	Barclays	16/10/2023	(390)
EUR	28.000	USD	30.980	UBS	16/10/2023	(539)
EUR	29.000	USD	31.932	Standard Chartered Bank	16/10/2023	(404)
GBP	110.000	USD	141.977	Morgan Stanley	16/10/2023	(2.515)
HKD	560.000	USD	71.794	Barclays	16/10/2023	(252)
HKD	19.000	USD	2.430	Standard Chartered Bank	16/10/2023	(2)
JPY	119.768.000	USD	861.916	Standard Chartered Bank	16/10/2023	(36.839)
JPY	7.096.000	USD	49.112	Morgan Stanley	16/10/2023	(228)
KRW	211.136.000	USD	163.135	Morgan Stanley	16/10/2023	(3.232)
NZD	1.810.000	USD	1.140.779	HSBC Bank	16/10/2023	(64.191)
SGD	61.000	USD	46.055	Barclays	16/10/2023	(840)
USD	4.183.049	EUR	3.863.811	BNY Mellon	14/9/2023	(11.007)
USD	321.877	EUR	294.996	Citigroup	14/9/2023	1.668
USD	306.092	CHF	263.000	UBS	16/10/2023	6.940
USD	11.180	EUR	10.000	UBS	16/10/2023	309
USD	79.120	HKD	618.000	UBS	16/10/2023	169
USD	1.420.173	GBP	1.093.000	Standard Chartered Bank	16/10/2023	34.432
USD	327.336	AED	1.202.000	BNP Paribas	16/10/2023	(17)
USD	457.897	CAD	610.000	Morgan Stanley	16/10/2023	6.721
USD	86.961	AUD	126.000	UBS	16/10/2023	5.218
USD	10.457	GBP	8.000	Morgan Stanley	16/10/2023	314
USD	63.813	GBP	50.000	HSBC Bank	16/10/2023	422
USD	46.644	EUR	42.000	HSBC Bank	16/10/2023	982
USD	263.833	EUR	237.433	Morgan Stanley	14/9/2023	6.106
USD	207.899	EUR	188.000	Standard Chartered Bank	16/10/2023	3.508
USD	33.814	CAD	45.000	HSBC Bank	16/10/2023	530
USD	248.728	CAD	332.000	Barclays	16/10/2023	3.170
USD	93.942	HKD	735.000	HSBC Bank	16/10/2023	43
USD	993.584	AUD	1.547.000	Morgan Stanley	16/10/2023	(10.048)
USD	81.011	EUR	74.000	Morgan Stanley	16/10/2023	560
USD	80.885	AED	297.000	Morgan Stanley	16/10/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(100.111)
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	199.491.350	USD	129.908.867	BNY Mellon	15/9/2023	(635.435)
USD	4.147.321	AUD	6.435.564	BNY Mellon	15/9/2023	(23.007)
Moins-value nette non réalisée						(658.442)
Catégorie d'Actions couverte en BRL						
BRL	32.872.200	USD	6.620.057	BNY Mellon	15/9/2023	40.149
USD	215.000	BRL	1.061.476	BNY Mellon	15/9/2023	(62)
Plus-value nette non réalisée						40.087
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	33.105.715	USD	24.613.368	BNY Mellon	15/9/2023	(138.247)
USD	1.279.951	CAD	1.735.438	BNY Mellon	15/9/2023	(3.061)
Moins-value nette non réalisée						(141.308)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	225.888	USD	258.636	BNY Mellon	15/9/2023	(2.569)
USD	7.315	CHF	6.424	BNY Mellon	15/9/2023	32
Moins-value nette non réalisée						(2.537)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	529.601.192	USD	73.375.361	BNY Mellon	15/9/2023	(539.731)
USD	2.899.955	CNY	21.106.646	BNY Mellon	15/9/2023	(2.811)
Moins-value nette non réalisée						(542.542)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	256.509.838	USD	281.406.266	BNY Mellon	15/9/2023	(2.957.312)
USD	16.819.991	EUR	15.420.078	BNY Mellon	15/9/2023	81.096
Moins-value nette non réalisée						(2.876.216)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	110.884.298	USD	141.067.976	BNY Mellon	15/9/2023	(498.437)
USD	4.300.655	GBP	3.386.424	BNY Mellon	15/9/2023	7.639
Moins-value nette non réalisée						(490.798)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	2.075.001.192	USD	265.838.112	BNY Mellon	15/9/2023	(1.127.431)
USD	12.101.929	HKD	94.669.408	BNY Mellon	15/9/2023	24.841
Moins-value nette non réalisée						(1.102.590)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	24.699.906	USD	14.909.855	BNY Mellon	15/9/2023	(219.206)
USD	487.743	NZD	821.896	BNY Mellon	15/9/2023	(1.093)
Moins-value nette non réalisée						(220.299)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	444.333.945	USD	330.077.692	BNY Mellon	15/9/2023	(1.193.965)
USD	9.988.997	SGD	13.533.374	BNY Mellon	15/9/2023	(28.002)
Moins-value nette non réalisée						(1.221.967)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.325.486.397)						(7.316.723)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
277	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	62.820.137	1.354.451
(527)	USD	EUR/USD Future	Septembre 2023	71.517.194	73.846
(1.266)	USD	GBP/USD Future	Septembre 2023	100.314.675	(314.031)
(148)	USD	JPY/USD Future	Septembre 2023	12.687.300	640.997
35	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	1.724.275	(13.235)
933	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	103.460.953	880.974
84	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	10.875.375	169.969
1.553	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	165.867.679	955.953
(36)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	3.992.062	(29.812)
6	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	640.828	4.687
26	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	2.776.922	17.189
21	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	2.718.844	37.451
Total				539.396.244	3.778.439

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
27.699	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.425	20/10/2023	(431.303)	1.043.669
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 37.079.155)						(431.303)	1.043.669

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Dynamic High Income Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(27.699)	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.125	20/10/2023	269.099	(326.000)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 9.622.774)						269.099	(326.000)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Égypte			
282.209	Commercial International Bank Egypt	HSBC Bank	57.812
(282.209)	Commercial International Bank Egypt	HSBC Bank	(55.801)
			2.011
Pays-Bas			
65.243	X5 Retail**	JP Morgan	231.613
			231.613
Vietnam			
244.100	Vietnam Dairy Products JSC	HSBC Bank	22.004
			22.004
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.061.270)			255.628

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Emerging Europe Fund⁽³⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Turquie			
				1.197.356	BIM Birlesik Magazalar	10.540.472	3,97
				666.507	D-MARKET Elektronik Hizmetler ve Ticaret	918.413	0,35
				1.465.891	Türkiye Petrol Rafinerileri	7.243.518	2,72
				17.000.000	Yapi ve Kredi Bankasi	9.359.201	3,52
						28.061.604	10,56
ACTIONS ORDINAIRES				Total des actions ordinaires			
						218.857.891	82,33
Canada				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
455.585	Eldorado Gold*	4.003.683	1,51			218.857.891	82,33
République tchèque				Autres titres négociables			
194.968	CEZ*	7.683.180	2,89	ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES			
Grèce				Chypre			
5.364.802	Eurobank Ergasias Services and	8.685.614	3,27	1.763.131	Fix Price**	2.843.903	1,07
460.515	Hellenic Telecommunications Organization*	6.410.369	2,41	501.349	Ozon**	4.621	0,00
891.983	National Bank of Greece	5.617.709	2,11	602.250	TCS**	8.414.938	3,17
638.955	OPAP*	9.993.256	3,76			11.263.462	4,24
1.774.139	Piraeus Financial	5.730.469	2,16	Pays-Bas			
		36.437.417	13,71	656.602	X5 Retail**	2.148.437	0,81
Hongrie				705.032	Yandex**	2.574	0,00
912.477	MOL Hungarian Oil & Gas	6.425.516	2,42			2.151.011	0,81
382.316	OTP Bank	14.466.343	5,44	Fédération de Russie			
488.524	Richter Gedeon*	11.471.305	4,31	215.510	Beluga**	21	0,00
		32.363.164	12,17	14.772.829	Gazprom**	1.419	0,00
Israël				909.617	LUKOIL**	88	0,00
627.543	Teva Pharmaceutical Industries	5.636.604	2,12	319.852	Magnit**	31	0,00
				4	Magnit**	-	0,00
Jersey				1.738.859	Magnitogorsk Iron & Steel Works**	167	0,00
271.615	Wizz Air*	7.295.991	2,74	400.708	MMC Norilsk Nickel**	4	0,00
Kazakhstan				2.595.735	Novatek**	249	0,00
482.039	Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC	6.504.523	2,44	3.198.945	Novolipetsk Steel**	307	0,00
124.728	Kaspi.KZ JSC	11.956.098	4,50	60.541	PhosAgro**	6	0,00
		18.460.621	6,94	1.169	PhosAgro**	11	0,00
Luxembourg				2	PhosAgro**	-	0,00
557.861	Allegro.eu*	4.117.509	1,55	2.124.338	Rosneft Oil**	204	0,00
699.004	InPost	7.608.659	2,86	16.322.530	Sberbank of Russia**	1.568	0,00
		11.726.168	4,41	3.538.428	Tatneft**	340	0,00
Pologne				89.700	Tatneft**	51	0,00
848.500	Bank Polska Kasa Opieki*	20.505.375	7,72	1.347.649	Tatneft**	129	0,00
174.847	KGHM Polska Miedz	4.473.902	1,68			4.595	0,00
943.548	ORLEN	13.286.599	5,00	Total des actions ordinaires et privilégiées			
1.313.532	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski*	11.004.457	4,14			13.419.068	5,05
1.507.705	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	13.987.425	5,26	Total des autres valeurs mobilières			
4.092.866	Tauron Polska Energia	3.931.701	1,48			13.419.068	5,05
		67.189.459	25,28	Total du portefeuille			
						232.276.959	87,38
				Autres éléments de l'actif net			
				Total de l'actif net (EUR)			
						33.556.078	12,62
						265.833.037	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Europe Fund⁽³⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	5.550	GBP	4.763	BNY Mellon	15/9/2023	(13)
GBP	77.084	EUR	89.395	BNY Mellon	15/9/2023	627
Plus-value nette non réalisée						614
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
EUR	22.954	SGD	33.872	BNY Mellon	15/9/2023	(142)
SGD	545.852	EUR	369.631	BNY Mellon	15/9/2023	2.562
Plus-value nette non réalisée						2.420
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 490.939)						3.034

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Moins-value non réalisée EUR
9.226	TRY	Bist 30 Index	Octobre 2023	28.225.035	(156.422)
Total				28.225.035	(156.422)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Finance	39,23
Biens de consommation non cyclique	11,21
Énergie	10,14
Biens de consommation cyclique	7,57
Technologie	4,50
Services aux collectivités	4,37
Communications	4,31
Matériaux de base	3,19
Valeurs industrielles	2,86
Autres éléments de l'actif net	12,62
	100,00

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 4.022.000	Bahrain Government International Bond 7,5% 20/9/2047*	3.714.779	0,38
COMPARTIMENTS				USD 1.300.000	Bahrain Government International Bond 7,75% 18/4/2035	1.334.503	0,13
Luxembourg							
3.120.000	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Corporate Bond Fund*	45.988.800	4,68				
Total des Compartiments				29.647.669 3,02			
OBLIGATIONS				Bénin			
Angola				EUR 2.383.000	Benin Government International Bond 4,95% 22/1/2035	1.825.775	0,19
USD 1.875.000	Angolan Government International Bond 8% 26/11/2029	1.552.294	0,16	Brésil			
USD 8.141.000	Angolan Government International Bond 8,75% 14/4/2032	6.706.922	0,68	USD 1.500.000	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 5,75% 26/9/2023	1.499.250	0,15
USD 4.449.000	Angolan Government International Bond 9,375% 8/5/2048	3.398.168	0,35	USD 6.259.000	Brazilian Government International Bond 4,25% 7/1/2025	6.144.930	0,63
				USD 1.318.000	Brazilian Government International Bond 4,625% 13/1/2028*	1.282.875	0,13
				USD 5.685.000	Brazilian Government International Bond 5% 27/1/2045	4.446.153	0,45
				USD 9.416.000	Brazilian Government International Bond 6% 20/10/2033	9.190.016	0,94
				22.563.224 2,30			
Argentine				Îles Caïmans			
USD 10.073.301	Argentine Republic Government International Bond 0,75% 9/7/2030	3.402.056	0,35	USD 2.800.000	DP World Crescent 3,75% 30/1/2030	2.585.436	0,26
USD 1.646.471	Argentine Republic Government International Bond 1% 9/7/2029	537.943	0,05	USD 7.950.000	Gaci First Investment 4,875% 14/2/2035	7.513.704	0,77
USD 18.266.680	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2035	5.480.643	0,56	USD 2.980.000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	2.947.160	0,30
USD 19.842.701	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2046	5.971.165	0,61	USD 3.035.000	Sharjah Sukuk Program 3,854% 3/4/2026	2.919.795	0,30
USD 10.400.070	Argentine Republic Government International Bond 4,25% 9/1/2038	3.666.597	0,37	USD 1.516.000	Sharjah Sukuk Program 4,226% 14/3/2028*	1.442.504	0,14
				17.408.599 1,77			
				Chili			
Azerbaïdjan				USD 1.700.000	Chile Government International Bond 2,45% 31/1/2031*	1.448.800	0,15
USD 2.173.000	Southern Gas Corridor CJSC 6,875% 24/3/2026	2.200.054	0,22	USD 2.208.000	Chile Government International Bond 2,55% 27/1/2032	1.857.215	0,19
Bahreïn				USD 1.975.000	Chile Government International Bond 2,55% 27/7/2033*	1.587.090	0,16
USD 3.130.000	Bahrain Government International Bond 5,45% 16/9/2032*	2.816.484	0,29	USD 9.966.000	Chile Government International Bond 3,5% 31/1/2034*	8.639.376	0,88
USD 4.012.000	Bahrain Government International Bond 5,625% 30/9/2031	3.699.024	0,38	USD 1.089.000	Chile Government International Bond 3,5% 25/1/2050	788.975	0,08
USD 5.223.000	Bahrain Government International Bond 6% 19/9/2044	4.216.397	0,43	USD 560.000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro 3,65% 7/5/2030*	506.257	0,05
USD 604.000	Bahrain Government International Bond 6,25% 25/1/2051*	483.517	0,05	USD 1.660.000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro 4,7% 7/5/2050	1.351.671	0,14
USD 7.305.000	Bahrain Government International Bond 6,75% 20/9/2029	7.306.534	0,74	USD 2.915.000	Empresa Nacional del Petroleo 3,75% 5/8/2026	2.742.243	0,28
USD 3.495.000	Bahrain Government International Bond 7% 26/1/2026	3.556.582	0,36	USD 2.300.000	Empresa Nacional del Petroleo 6,15% 10/5/2033	2.276.609	0,23
USD 2.455.000	Bahrain Government International Bond 7,375% 14/5/2030	2.519.849	0,26	USD 2.372.000	Inversiones CMPC 6,125% 23/6/2033*	2.366.865	0,24
				USD 2.580.000	Nacional del Cobre de Chile 3% 30/9/2029	2.239.633	0,23
				USD 1.051.000	Nacional del Cobre de Chile 3,625% 1/8/2027	975.917	0,10

∞ Participation croisée d'un fonds à compartiments multiples et investissement dans le fonds d'une partie liée, pour de plus amples informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.010.000	Nacional del Cobre de Chile 3,7% 30/1/2050*	1.409.522	0,14	République dominicaine			
USD 7.990.000	Nacional del Cobre de Chile 5,125% 2/2/2033*	7.660.253	0,78	USD 5.466.000	Dominican Republic International Bond 4,5% 30/1/2030	4.779.798	0,49
		35.850.426	3,65	USD 3.273.000	Dominican Republic International Bond 4,875% 23/9/2032	2.776.617	0,28
Colombie				USD 2.645.000	Dominican Republic International Bond 6% 19/7/2028	2.561.696	0,26
USD 3.929.000	Colombia Government International Bond 3% 30/1/2030*	3.123.535	0,32	USD 10.405.000	Dominican Republic International Bond 6% 22/2/2033*	9.600.849	0,98
USD 5.119.000	Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031	3.948.029	0,40	USD 2.271.000	Dominican Republic International Bond 6,4% 5/6/2049*	1.893.446	0,19
USD 3.622.000	Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	3.342.599	0,34	USD 1.223.000	Dominican Republic International Bond 6,5% 15/2/2048*	1.047.879	0,11
USD 1.530.000	Colombia Government International Bond 4,5% 15/3/2029*	1.365.097	0,14	USD 3.600.000	Dominican Republic International Bond 7,05% 3/2/2031	3.577.086	0,36
USD 15.096.000	Colombia Government International Bond 5% 15/6/2045*	10.624.640	1,08			26.237.371	2,67
USD 5.725.000	Colombia Government International Bond 5,2% 15/5/2049*	4.033.749	0,41	Équateur			
USD 4.670.000	Colombia Government International Bond 5,625% 26/2/2044*	3.547.636	0,36	USD 5.724.827	Ecuador Government International Bond 2,5% 31/7/2040	1.916.758	0,20
USD 2.306.000	Colombia Government International Bond 6,125% 18/1/2041	1.907.074	0,19	USD 18.816.113	Ecuador Government International Bond 3,5% 31/7/2035	7.066.297	0,72
USD 4.927.000	Colombia Government International Bond 7,5% 2/2/2034	4.887.953	0,50	USD 6.240.300	Ecuador Government International Bond 6% 31/7/2030	3.092.599	0,31
		36.780.312	3,74			12.075.654	1,23
Costa Rica				Égypte			
USD 1.734.000	Costa Rica Government International Bond 4,375% 30/4/2025	1.694.335	0,17	USD 6.460.000	Egypt Government International Bond 5,25% 6/10/2025*	5.029.950	0,51
USD 463.000	Costa Rica Government International Bond 5,625% 30/4/2043	403.449	0,04	USD 10.330.000	Egypt Government International Bond 7,3% 30/9/2033	5.725.351	0,58
USD 2.084.000	Costa Rica Government International Bond 6,125% 19/2/2031	2.083.291	0,21	USD 4.730.000	Egypt Government International Bond 7,5% 16/2/2061	2.397.802	0,24
USD 1.012.000	Costa Rica Government International Bond 7% 4/4/2044*	1.006.211	0,10	USD 4.550.000	Egypt Government International Bond 7,6% 1/3/2029*	2.936.092	0,30
USD 2.005.000	Costa Rica Government International Bond 7,158% 12/3/2045	2.021.271	0,21	USD 10.691.000	Egypt Government International Bond 7,625% 29/5/2032	6.160.528	0,63
USD 1.128.000	Instituto Costarricense de Electricidad 6,375% 15/5/2043	947.261	0,10	USD 940.000	Egypt Government International Bond 8,15% 20/11/2059	484.786	0,05
		8.155.818	0,83	USD 3.082.000	Egypt Government International Bond 8,7% 1/3/2049	1.639.008	0,17
Côte d'Ivoire				USD 5.249.000	Egypt Government International Bond 8,875% 29/5/2050	2.824.802	0,29
EUR 4.608.000	Ivory Coast Government International Bond 4,875% 30/1/2032	3.867.582	0,39			27.198.319	2,77
USD 2.117.540	Ivory Coast Government International Bond 5,75% 31/12/2032	1.927.162	0,20	El Salvador			
USD 1.874.000	Ivory Coast Government International Bond 6,125% 15/6/2033*	1.606.983	0,16	USD 5.984.000	El Salvador Government International Bond 6,375% 18/1/2027	4.698.547	0,48
		7.401.727	0,75	USD 2.475.000	El Salvador Government International Bond 7,65% 15/6/2035	1.756.062	0,18
				USD 1.286.000	El Salvador Government International Bond 8,625% 28/2/2029*	991.982	0,10
						7.446.591	0,76
				Éthiopie			
				USD 1.785.000	Ethiopia International Bond 6,625% 11/12/2024	1.179.135	0,12

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Gabon				USD 2.350.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 6,125% 4/12/2027	2.340.024	0,24
USD 2.022.000	Gabon Government International Bond 6,625% 6/2/2031	1.474.736	0,15	USD 3.090.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6,5% 29/6/2028	3.113.947	0,31
USD 727.000	Gabon Government International Bond 6,95% 16/6/2025	611.552	0,06	USD 9.076.000	MVM Energetika Zrt 7,5% 9/6/2028	9.246.175	0,94
USD 644.000	Gabon Government International Bond 7% 24/11/2031	468.829	0,05			35.332.060	3,59
		2.555.117	0,26	Inde			
				USD 2.075.000	Export-Import Bank of India 3,375% 5/8/2026	1.959.412	0,20
Ghana				Indonésie			
USD 2.950.000	Ghana Government International Bond 6,375% 11/2/2027	1.290.478	0,13	USD 960.000	Indonesia Government International Bond 3,5% 11/1/2028	897.355	0,09
USD 5.835.000	Ghana Government International Bond 7,625% 16/5/2029	2.528.539	0,26	USD 3.885.000	Indonesia Government International Bond 3,55% 31/3/2032	3.463.582	0,36
USD 4.618.600	Ghana Government International Bond 8,125% 18/1/2026	2.128.459	0,22	EUR 2.500.000	Indonesia Government International Bond 3,75% 14/6/2028	2.673.861	0,27
USD 7.656.000	Ghana Government International Bond 8,125% 26/3/2032	3.341.767	0,34	USD 3.867.000	Indonesia Government International Bond 4,125% 15/1/2025	3.813.713	0,39
USD 6.400.000	Ghana Government International Bond 8,625% 7/4/2034	2.828.064	0,29	USD 4.775.000	Indonesia Government International Bond 4,35% 11/1/2048*	4.096.043	0,42
USD 1.976.000	Ghana Government International Bond 8,95% 26/3/2051	849.680	0,08	USD 7.175.000	Indonesia Government International Bond 4,55% 11/1/2028*	7.032.827	0,71
		12.966.987	1,32	USD 5.469.000	Indonesia Government International Bond 4,75% 8/1/2026	5.423.389	0,55
Guatemala				USD 1.007.000	Indonesia Government International Bond 4,75% 18/7/2047*	927.226	0,09
USD 1.110.000	Guatemala Government Bond 4,375% 5/6/2027	1.047.513	0,11	USD 1.660.000	Indonesia Government International Bond 4,85% 11/1/2033*	1.628.767	0,17
USD 3.196.000	Guatemala Government Bond 4,5% 3/5/2026*	3.075.463	0,31	USD 4.162.000	Indonesia Government International Bond 5,25% 17/1/2042*	4.131.846	0,42
USD 1.397.000	Guatemala Government Bond 5,375% 24/4/2032	1.332.682	0,14	USD 3.328.000	Indonesia Government International Bond 5,25% 8/1/2047*	3.266.848	0,33
USD 2.855.000	Guatemala Government Bond 6,125% 1/6/2050*	2.608.499	0,26	USD 3.378.000	Pertamina Persero 4,7% 30/7/2049*	2.764.234	0,28
		8.064.157	0,82	USD 2.998.000	Pertamina Persero 5,625% 20/5/2043	2.801.541	0,29
Hong Kong				USD 525.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,4% 6/6/2027*	513.828	0,05
USD 4.368.000	CNAC HK Finbridge 4,125% 19/7/2027	4.118.369	0,42	USD 3.570.000	Perusahaan Perseroan Persero Perusahaan Listrik Negara 4,125% 15/5/2027	3.397.373	0,34
Hongrie						46.832.433	4,76
USD 4.567.000	Hungary Government International Bond 2,125% 22/9/2031	3.524.560	0,36	International			
USD 1.750.000	Hungary Government International Bond 3,125% 21/9/2051	1.061.226	0,11	EUR 2.455.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 2,75% 22/1/2033*	1.949.818	0,20
USD 6.145.000	Hungary Government International Bond 5,25% 16/6/2029	6.015.464	0,61	Jamaïque			
USD 206.000	Hungary Government International Bond 5,375% 25/3/2024	205.648	0,02	USD 610.000	Jamaica Government International Bond 6,75% 28/4/2028	630.956	0,06
USD 994.000	Hungary Government International Bond 5,5% 16/6/2034	945.090	0,10	USD 1.419.000	Jamaica Government International Bond 7,875% 28/7/2045*	1.616.383	0,17
USD 6.245.000	Hungary Government International Bond 6,125% 22/5/2028	6.342.953	0,64			2.247.339	0,23
USD 2.495.000	Hungary Government International Bond 6,75% 25/9/2052*	2.536.973	0,26				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Jordanie				USD 6.503.000	Mexico Government International Bond 3,5% 12/2/2034	5.409.316	0,55
USD 1.853.000	Jordan Government International Bond 5,75% 31/1/2027	1.811.493	0,18	USD 295.000	Mexico Government International Bond 3,75% 11/1/2028	279.874	0,03
USD 5.943.000	Jordan Government International Bond 5,85% 7/7/2030	5.498.137	0,56	USD 3.584.000	Mexico Government International Bond 4,15% 28/3/2027	3.516.961	0,36
USD 2.872.000	Jordan Government International Bond 7,375% 10/10/2047*	2.519.433	0,26	USD 2.387.000	Mexico Government International Bond 4,4% 12/2/2052*	1.833.956	0,18
		9.829.063	1,00	USD 1.400.000	Mexico Government International Bond 4,5% 22/4/2029*	1.352.323	0,14
Kazakhstan				USD 3.115.000	Mexico Government International Bond 4,6% 23/1/2046	2.522.916	0,26
USD 2.100.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 5,75% 12/5/2025	2.103.969	0,21	USD 4.630.000	Mexico Government International Bond 4,75% 27/4/2032*	4.394.403	0,45
USD 1.914.000	Kazakhstan Government International Bond 4,875% 14/10/2044*	1.714.762	0,18	USD 2.958.000	Mexico Government International Bond 5,75% 12/10/2110	2.584.937	0,26
USD 289.000	Kazakhstan Government International Bond 6,5% 21/7/2045*	303.833	0,03	USD 2.085.000	Mexico Government International Bond 6,338% 4/5/2053	2.078.745	0,21
		4.122.564	0,42	USD 3.575.000	Mexico Government International Bond 6,35% 9/2/2035	3.712.977	0,38
Kenya				USD 6.770.000	Petroleos Mexicanos 6,35% 12/2/2048	4.074.863	0,42
USD 2.111.000	Republic of Kenya Government International Bond 6,875% 24/6/2024	2.005.883	0,20	USD 3.203.000	Petroleos Mexicanos 6,5% 13/3/2027	2.813.515	0,29
USD 2.717.000	Republic of Kenya Government International Bond 7% 22/5/2027*	2.417.315	0,25	USD 6.041.000	Petroleos Mexicanos 6,7% 16/2/2032	4.573.641	0,46
USD 3.459.000	Republic of Kenya Government International Bond 8% 22/5/2032*	2.875.293	0,29	USD 10.520.000	Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047	6.544.072	0,67
USD 4.268.000	Republic of Kenya Government International Bond 8,25% 28/2/2048*	3.196.604	0,33	USD 2.830.000	Petroleos Mexicanos 6,84% 23/1/2030*	2.239.492	0,22
		10.495.095	1,07	USD 4.839.000	Petroleos Mexicanos 6,95% 28/1/2060	3.004.535	0,30
Liban						54.328.301	5,52
USD 5.060.000	Lebanon Government International Bond 6% 27/1/2023***	430.100	0,04	Mongolie			
USD 9.570.000	Lebanon Government International Bond 6,2% 26/2/2025***	763.399	0,08	USD 2.017.000	Mongolia Government International Bond 5,125% 7/4/2026*	1.873.218	0,19
USD 12.847.000	Lebanon Government International Bond 6,6% 27/11/2026***	1.024.998	0,10	USD 1.990.000	Mongolia Government International Bond 8,65% 19/1/2028	1.998.086	0,20
USD 10.461.000	Lebanon Government International Bond 6,65% 22/4/2024***	849.956	0,09			3.871.304	0,39
USD 8.172.000	Lebanon Government International Bond 6,65% 26/2/2030***	652.902	0,07	Maroc			
		3.721.355	0,38	USD 2.980.000	Morocco Government International Bond 2,375% 15/12/2027	2.598.635	0,26
Malaisie				USD 2.396.000	Morocco Government International Bond 3% 15/12/2032*	1.873.456	0,19
USD 2.353.000	Petronas Capital 3,5% 18/3/2025	2.282.810	0,23	USD 5.104.000	Morocco Government International Bond 4% 15/12/2050	3.345.570	0,34
USD 3.399.000	Petronas Capital 3,5% 21/4/2030	3.089.062	0,32	USD 2.130.000	Morocco Government International Bond 6,5% 8/9/2033*	2.144.218	0,22
USD 3.955.000	Petronas Capital 4,55% 21/4/2050	3.447.178	0,35			9.961.879	1,01
		8.819.050	0,90	Namibie			
Mexique				USD 1.222.000	Namibia International Bonds 5,25% 29/10/2025	1.163.955	0,12
USD 4.096.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	3.391.775	0,34				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nigéria				USD 470.000	Panama Government International Bond 3,87% 23/7/2060	299.810	0,03
USD 5.571.000	Nigeria Government International Bond 6,5% 28/11/2027	4.773.511	0,49	USD 7.311.000	Panama Government International Bond 3,875% 17/3/2028*	6.883.197	0,70
USD 4.871.000	Nigeria Government International Bond 7,143% 23/2/2030	3.961.950	0,40	USD 5.007.000	Panama Government International Bond 4,3% 29/4/2053	3.592.848	0,37
USD 712.000	Nigeria Government International Bond 7,625% 21/11/2025	677.703	0,07	USD 6.560.000	Panama Government International Bond 4,5% 16/4/2050	4.907.831	0,50
USD 2.130.000	Nigeria Government International Bond 7,696% 23/2/2038	1.546.146	0,16	USD 2.710.000	Panama Government International Bond 6,4% 14/2/2035	2.782.923	0,28
USD 4.669.000	Nigeria Government International Bond 7,875% 16/2/2032	3.793.679	0,39			32.924.918	3,35
USD 6.550.000	Nigeria Government International Bond 8,25% 28/9/2051	4.655.412	0,47	Paraguay			
USD 1.500.000	Nigeria Government International Bond 8,375% 24/3/2029	1.327.500	0,13	USD 1.169.000	Paraguay Government International Bond 2,739% 29/1/2033	922.744	0,09
		20.735.901	2,11	USD 2.801.000	Paraguay Government International Bond 4,7% 27/3/2027	2.711.256	0,28
Oman				USD 2.709.000	Paraguay Government International Bond 4,95% 28/4/2031	2.566.656	0,26
USD 1.793.000	Oman Government International Bond 5,375% 8/3/2027	1.769.198	0,18	USD 1.060.000	Paraguay Government International Bond 5% 15/4/2026	1.037.687	0,11
USD 5.790.000	Oman Government International Bond 5,625% 17/1/2028	5.729.726	0,58			7.238.343	0,74
USD 7.300.000	Oman Government International Bond 6,5% 8/3/2047	6.871.235	0,70	Pérou			
USD 2.105.000	Oman Government International Bond 6,75% 28/10/2027	2.171.265	0,22	USD 2.260.000	Financiera de Desarrollo 2,4% 28/9/2027*	1.972.799	0,20
USD 551.000	Oman Government International Bond 6,75% 17/1/2048*	532.836	0,05	USD 1.417.000	Financiera de Desarrollo 4,75% 15/7/2025	1.389.744	0,14
USD 4.310.000	Oman Government International Bond 7% 25/1/2051	4.275.111	0,44	USD 175.000	Fondo MIVIVIENDA 4,625% 12/4/2027	168.120	0,02
USD 3.147.000	Oman Government International Bond 7,375% 28/10/2032	3.442.204	0,35	USD 2.790.000	Peruvian Government International Bond 2,392% 23/1/2026*	2.614.704	0,27
		24.791.575	2,52	USD 4.633.000	Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031	3.933.394	0,40
Pakistan				USD 13.208.000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034	10.728.859	1,09
USD 7.347.000	Pakistan Government International Bond 6% 8/4/2026	3.840.277	0,39	USD 2.767.000	Peruvian Government International Bond 3,23% 28/7/2121	1.601.083	0,16
USD 5.533.000	Pakistan Government International Bond 6,875% 5/12/2027	2.840.089	0,29	USD 2.440.000	Peruvian Government International Bond 4,125% 25/8/2027	2.363.469	0,24
		6.680.366	0,68	USD 3.077.000	Petroleos del Peru 4,75% 19/6/2032	2.285.442	0,23
Panama						27.057.614	2,75
USD 8.210.000	Panama Government International Bond 2,252% 29/9/2032*	6.229.707	0,63	Philippines			
USD 2.822.000	Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030	2.455.888	0,25	USD 2.279.000	Philippine Government International Bond 3% 1/2/2028	2.103.119	0,21
USD 4.350.000	Panama Government International Bond 3,298% 19/1/2033	3.576.853	0,37	USD 4.440.000	Philippine Government International Bond 3,556% 29/9/2032*	3.985.588	0,41
USD 2.260.000	Panama Government International Bond 3,75% 16/3/2025	2.195.861	0,22	USD 2.230.000	Philippine Government International Bond 5,5% 17/1/2048*	2.247.628	0,23
						8.336.335	0,85

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Pologne				USD 3.595.000	Saudi Government International Bond 3,75% 21/1/2055	2.579.287	0,26
USD 3.795.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375% 22/5/2033	3.723.844	0,38	USD 4.400.000	Saudi Government International Bond 4,625% 4/10/2047	3.739.054	0,38
USD 5.955.000	Republic of Poland Government International Bond 4,875% 4/10/2033*	5.781.918	0,59	USD 4.492.000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053	3.999.564	0,41
USD 3.075.000	Republic of Poland Government International Bond 5,5% 16/11/2027	3.134.732	0,32			26.089.755	2,66
USD 2.790.000	Republic of Poland Government International Bond 5,75% 16/11/2032	2.903.971	0,29	Sénégal			
		15.544.465	1,58	EUR 1.950.000	Senegal Government International Bond 4,75% 13/3/2028*	1.827.620	0,19
Qatar				USD 1.597.000	Senegal Government International Bond 6,25% 23/5/2033*	1.310.035	0,13
USD 288.000	Qatar Government International Bond 3,75% 16/4/2030	272.913	0,03	USD 1.451.000	Senegal Government International Bond 6,75% 13/3/2048	1.012.457	0,10
USD 10.374.000	Qatar Government International Bond 4,817% 14/3/2049	9.671.660	0,98			4.150.112	0,42
		9.944.573	1,01	Serbie			
Roumanie				USD 250.000	Serbia International Bond 2,125% 1/12/2030	190.995	0,02
EUR 8.659.000	Romanian Government International Bond 2% 14/4/2033*	6.689.477	0,68	USD 6.660.000	Serbia International Bond 6,25% 26/5/2028*	6.638.688	0,67
USD 2.080.000	Romanian Government International Bond 3% 27/2/2027	1.910.553	0,20			6.829.683	0,69
USD 3.322.000	Romanian Government International Bond 3% 14/2/2031*	2.753.905	0,28	Afrique du Sud			
USD 7.432.000	Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027	7.303.946	0,74	USD 1.711.000	Eskom SOC 8,45% 10/8/2028	1.664.778	0,17
USD 1.520.000	Romanian Government International Bond 6% 25/5/2034	1.484.151	0,15	ZAR 31.260.055	Republic of South Africa Government Bond 7% 28/2/2031	1.351.232	0,14
USD 3.926.000	Romanian Government International Bond 6,625% 17/2/2028	4.062.684	0,41	USD 5.175.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,3% 12/10/2028	4.580.289	0,46
USD 3.588.000	Romanian Government International Bond 7,125% 17/1/2033*	3.769.355	0,38	USD 2.960.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,85% 30/9/2029*	2.612.111	0,26
USD 1.882.000	Romanian Government International Bond 7,625% 17/1/2053*	2.028.037	0,21	USD 1.512.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,875% 14/4/2026	1.459.882	0,15
		30.002.108	3,05	USD 3.691.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,65% 27/9/2047*	2.625.316	0,27
Rwanda				USD 6.457.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,75% 30/9/2049	4.596.125	0,47
USD 3.743.000	Rwanda International Government Bond 5,5% 9/8/2031	2.913.401	0,30	USD 6.393.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 22/6/2030	5.835.690	0,59
Arabie Saoudite				USD 2.413.000	Republic of South Africa Government International Bond 7,3% 20/4/2052*	2.046.572	0,21
USD 3.247.000	Saudi Arabian Oil 3,5% 24/11/2070*	2.053.484	0,21	USD 7.485.000	Transnet SOC 8,25% 6/2/2028	7.286.535	0,74
USD 8.930.000	Saudi Government International Bond 2,25% 2/2/2033	7.107.699	0,72			34.058.530	3,46
USD 5.217.000	Saudi Government International Bond 2,75% 3/2/2032*	4.466.013	0,46	Sri Lanka			
USD 2.380.000	Saudi Government International Bond 3,25% 22/10/2030	2.144.654	0,22	USD 450.000	Sri Lanka Government International Bond 5,75% 18/4/2023***	210.812	0,02
				USD 5.532.000	Sri Lanka Government International Bond 6,125% 3/6/2025	2.636.607	0,27
				USD 3.966.000	Sri Lanka Government International Bond 6,2% 11/5/2027	1.802.686	0,18

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 5.819.000	Sri Lanka Government International Bond 6,35% 28/6/2024	2.715.145	0,28	USD 300.000	UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 4,05% 7/7/2032	286.993	0,03
USD 3.292.000	Sri Lanka Government International Bond 7,55% 28/3/2030	1.491.342	0,15	USD 3.895.000	UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 4,951% 7/7/2052*	3.697.485	0,37
		8.856.592	0,90			15.268.778	1,55
	Suède				Royaume-Uni		
EUR 791.925	East Renewable 13,5% 1/1/2025	107.399	0,01	USD 8.569.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance 7,625% 8/11/2026	3.398.080	0,35
	Trinité-et-Tobago				Uruguay		
USD 2.387.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 4,5% 4/8/2026	2.314.197	0,24	USD 3.976.045	Uruguay Government International Bond 4,125% 20/11/2045	3.511.921	0,35
USD 2.071.000	Trinidad Generation 5,25% 4/11/2027	2.010.278	0,20	USD 7.455.100	Uruguay Government International Bond 4,375% 23/1/2031	7.344.205	0,75
		4.324.475	0,44	USD 3.146.626	Uruguay Government International Bond 5,1% 18/6/2050	3.031.979	0,31
	Tunisie					13.888.105	1,41
USD 2.912.000	Tunisian Republic 5,75% 30/1/2025	2.003.238	0,20		Uzbekistan		
	Ukraine			USD 2.010.000	Republic of Uzbekistan International Bond 5,375% 20/2/2029	1.842.396	0,19
USD 1.923.000	Ukraine Government International Bond 6,876% 21/5/2031	512.480	0,05		Venezuela		
USD 2.929.000	Ukraine Government International Bond 7,253% 15/3/2035	793.202	0,08	USD 131.497.923	Petroleos de Venezuela 6% 16/5/2024***	9.073.357	0,92
USD 2.320.000	Ukraine Government International Bond 7,375% 25/9/2034	617.700	0,06	USD 15.499.059	Petroleos de Venezuela 6% 15/11/2026***	1.084.934	0,11
USD 3.293.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2025	1.070.225	0,11	USD 2.936.500	Petroleos de Venezuela 8,5% 27/10/2020***	1.482.037	0,15
USD 26.575.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2026	7.746.612	0,79	USD 39.633.022	Petroleos de Venezuela 9% 17/11/2021***	2.524.152	0,26
USD 10.488.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2027	3.024.215	0,31	USD 127.413.677	Petroleos de Venezuela 9,75% 17/5/2035***	8.600.423	0,88
USD 141.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2028	40.749	0,01	USD 76.618.400	Petroleos de Venezuela 12,75% 17/2/2022***	5.171.742	0,53
USD 2.319.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2029	670.191	0,07	USD 7.000	Venezuela Government International Bond 0% 31/12/9999	350	0,00
USD 12.228.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/8/2041	5.624.880	0,57			27.936.995	2,85
		20.100.254	2,05		Zambie		
	Émirats arabes unis			USD 1.671.000	Zambia Government International Bond 5,375% 20/9/2022***	803.166	0,08
USD 1.182.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline 4,6% 2/11/2047	1.055.556	0,11	USD 2.347.000	Zambia Government International Bond 8,5% 14/4/2024	1.246.433	0,13
USD 2.914.000	Abu Dhabi Government International Bond 3,875% 16/4/2050	2.345.755	0,24	USD 2.112.000	Zambia Government International Bond 8,97% 30/7/2027	1.110.986	0,11
USD 3.539.000	DP World/United Arab Emirates 4,7% 30/9/2049*	2.927.708	0,30			3.160.585	0,32
USD 2.230.000	MDGH GMTN RSC 2,875% 21/5/2030	1.965.544	0,20	Total des obligations		847.209.296	86,20
USD 1.110.000	MDGH GMTN RSC 3% 19/4/2024*	1.089.299	0,11	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		893.198.096	90,88
USD 2.125.000	MDGH GMTN RSC 3,375% 28/3/2032*	1.900.438	0,19				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Autres titres négociables			
OBLIGATIONS			
États-Unis			
USD 16.110	Lehman Brothers 0% 31/12/2049**	–	0,00
USD 16.111	Lehman Brothers Special Finance 0% 31/12/2049**	–	0,00
		–	0,00
Total des obligations		–	0,00
Total des autres valeurs mobilières		–	0,00
Total du portefeuille		893.198.096	90,88
Autres éléments de l'actif net		89.680.436	9,12
Total de l'actif net (USD)		982.878.532	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	6.828.900	USD	4.561.233	Bank of America	13/9/2023	(136.336)
BRL	62.524.010	USD	13.160.290	JP Morgan	5/9/2023	(471.847)
BRL	32.384.000	USD	6.591.492	Goldman Sachs	5/9/2023	(19.576)
BRL	62.524.010	USD	12.703.536	Goldman Sachs	3/10/2023	(72.911)
CNH	1.710.000	USD	237.272	BNY Mellon	13/9/2023	(2.122)
EUR	950.000	USD	1.037.656	Morgan Stanley	13/9/2023	(6.509)
EUR	1.390.000	USD	1.516.966	Royal Bank of Canada	13/9/2023	(8.234)
EUR	3.240.000	USD	3.523.955	BNY Mellon	13/9/2023	(7.201)
GBP	400.000	USD	510.683	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(3.602)
HUF	87.030.000	USD	244.569	Toronto-Dominion	13/9/2023	3.255
HUF	836.310.000	USD	2.368.292	Goldman Sachs	13/9/2023	13.166
HUF	2.532.930.000	USD	7.173.958	Morgan Stanley	13/9/2023	38.758
JPY	1.266.321.030	USD	8.886.780	Morgan Stanley	13/9/2023	(210.044)
MXN	161.750.000	USD	9.324.895	Citigroup	13/9/2023	325.110
MXN	266.580.000	USD	15.520.169	JP Morgan	13/9/2023	383.995
MXN	246.840.000	USD	14.383.358	Morgan Stanley	13/9/2023	343.117
NZD	380.000	USD	235.869	Morgan Stanley	13/9/2023	(9.860)
PLN	29.070.000	USD	7.160.697	Barclays	13/9/2023	(106.812)
PLN	19.020.000	USD	4.652.096	Goldman Sachs	13/9/2023	(36.860)
PLN	19.620.000	USD	4.854.733	Deutsche Bank	13/9/2023	(93.906)
PLN	68.197.000	USD	16.853.140	UBS	13/9/2023	(305.020)
TRY	95.279.500	USD	3.496.495	Goldman Sachs	17/10/2023	(27.049)
USD	7.320.786	HUF	2.605.101.900	Toronto-Dominion	13/9/2023	(97.444)
USD	23.833.391	EUR	21.820.069	Morgan Stanley	13/9/2023	149.493
USD	6.637.252	PLN	27.363.400	Bank of America	13/9/2023	(2.524)
USD	2.960.571	ZAR	56.653.499	Morgan Stanley	13/9/2023	(52.127)
USD	6.122.099	COP	25.890.355.900	JP Morgan	13/9/2023	(164.057)
USD	8.224.920	MXN	141.995.016	Bank of America	13/9/2023	(246.503)
USD	9.221.493	MXN	161.870.000	JP Morgan	13/9/2023	(435.672)
USD	8.159.305	PLN	33.286.629	UBS	13/9/2023	82.247
USD	184.001	ZAR	3.540.000	Toronto-Dominion	13/9/2023	(4.248)
USD	9.138.319	ZAR	176.020.000	UBS	13/9/2023	(222.007)
USD	12.019.114	PLN	49.470.000	Goldman Sachs	13/9/2023	15.133
USD	7.239.567	TRY	205.146.318	UBS	17/10/2023	(230.500)
USD	766.130	EUR	680.000	State Street	13/9/2023	28.046
USD	524.183	EUR	470.000	Deutsche Bank	13/9/2023	14.037

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	278.595	EUR	250.000	Royal Bank of Canada	13/9/2023	7.240
USD	9.455.786	HUF	3.388.080.000	JP Morgan	13/9/2023	(192.036)
USD	7.241.705	BRL	34.820.000	JP Morgan	5/9/2023	175.434
USD	4.804.815	PLN	19.520.000	Deutsche Bank	13/9/2023	68.253
USD	10.920.776	MXN	185.660.000	Goldman Sachs	13/9/2023	(155.701)
USD	19.081.671	MXN	327.850.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(477.861)
USD	1.616.300	PLN	6.593.371	BNP Paribas	13/9/2023	16.407
USD	7.227.831	PLN	29.230.000	Toronto-Dominion	13/9/2023	135.121
USD	5.159.059	ZAR	99.310.000	Goldman Sachs	13/9/2023	(122.011)
USD	151.268	EUR	140.000	Toronto-Dominion	13/9/2023	(690)
USD	12.759.716	BRL	62.524.010	Goldman Sachs	5/9/2023	71.273
ZAR	224.598.544	USD	11.779.563	Morgan Stanley	13/9/2023	164.055
ZAR	86.620.000	USD	4.568.640	Barclays	13/9/2023	37.606
ZAR	95.980.000	USD	5.055.203	Goldman Sachs	13/9/2023	48.786
Moins-value nette non réalisée						(1.800.738)
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	8.374.749	USD	5.452.346	BNY Mellon	15/9/2023	(25.382)
USD	180.081	AUD	279.716	BNY Mellon	15/9/2023	(1.179)
Moins-value nette non réalisée						(26.561)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	4.714.381	USD	3.505.494	BNY Mellon	15/9/2023	(20.142)
USD	70.397	CAD	95.273	BNY Mellon	15/9/2023	(39)
Moins-value nette non réalisée						(20.181)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	11.805.695	USD	13.517.613	BNY Mellon	15/9/2023	(134.650)
USD	246.065	CHF	215.787	BNY Mellon	15/9/2023	1.449
Moins-value nette non réalisée						(133.201)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	27.924	USD	3.869	BNY Mellon	15/9/2023	(29)
USD	68	CNY	498	BNY Mellon	15/9/2023	(1)
Moins-value nette non réalisée						(30)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	295.510.720	USD	324.216.643	BNY Mellon	15/9/2023	(3.431.074)
USD	6.606.594	EUR	6.063.766	BNY Mellon	15/9/2023	24.223
Moins-value nette non réalisée						(3.406.851)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	17.633.811	USD	22.436.000	BNY Mellon	15/9/2023	(81.375)
USD	1.189.882	GBP	934.359	BNY Mellon	15/9/2023	5.380
Moins-value nette non réalisée						(75.995)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	139.814.503	USD	17.912.991	BNY Mellon	15/9/2023	(76.668)
USD	410.958	HKD	3.214.946	BNY Mellon	15/9/2023	824
Moins-value nette non réalisée						(75.844)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	2.248.564	USD	1.358.488	BNY Mellon	15/9/2023	(21.120)
USD	26.838	NZD	45.235	BNY Mellon	15/9/2023	(66)
Moins-value nette non réalisée						(21.186)
Catégorie d'Actions couverte en ZAR						
USD	20.800	ZAR	397.738	BNY Mellon	15/9/2023	(348)
ZAR	13.571.519	USD	719.724	BNY Mellon	15/9/2023	1.853
Plus-value nette non réalisée						1.505
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 737.435.656)						(5.559.082)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Bond Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
79	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	11.399.520	76.782
13	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	1.441.578	11.006
(33)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	3.827.484	(42.024)
33	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	4.272.469	43.055
74	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	7.903.547	46.828
Total				28.844.598	135.647

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 8.635.500	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(419.552)	379.684
CDS	USD (1.450.000)	Fund provides default protection on Mexican; and receives Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	1.453	661
CDS	USD (8.000.000)	Fund provides default protection on Mexican; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	31.184	3.648
CDS	USD (2.415.000)	Fund provides default protection on South Africa; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(2.182)	(142.973)
CDS	USD 8.000.000	Fund receives default protection on Chile; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(32.859)	(148.541)
CDS	USD 5.000.000	Fund receives default protection on Chile; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(17.592)	(92.838)
CDS	USD 3.000.000	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(279.674)	324.397
CDS	USD 10.114.000	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(554.444)	1.093.652
CDS	USD 11.658.100	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(511.720)	313.227
IRS	USD 510.000	Fund receives Fixed 3,5783%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14/8/2053	3.826	3.826
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 61.317.908)					(1.781.560)	1.734.743

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Emerging Markets Corporate Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 7.932.000	Melco Resorts Finance 5,75% 21/7/2028*	7.036.517	0,90
				USD 4.966.000	MGM China 4,75% 1/2/2027*	4.489.711	0,57
				USD 2.315.000	QNB Finance 1,375% 26/1/2026*	2.097.853	0,27
				USD 2.252.000	QNB Finance 2,75% 12/2/2027	2.074.576	0,26
				USD 4.235.000	Sands China 5,65% 8/8/2028	3.988.417	0,51
				USD 2.960.000	Saudi Electricity Sukuk Programme 5,684% 11/4/2053	2.839.409	0,36
				USD 500.000	Sunac China 5,95% 26/4/2024***	55.000	0,01
				USD 750.000	Sunac China 6,65% 3/8/2024	82.500	0,01
				USD 9.747.000	Vale Overseas 3,75% 8/7/2030	8.527.309	1,09
				USD 8.000.000	Vale Overseas 6,125% 12/6/2033*	7.962.000	1,02
				USD 2.600.000	Weibo 3,375% 8/7/2030*	2.036.736	0,26
				USD 8.202.000	Wynn Macau 5,5% 15/1/2026*	7.698.439	0,99
				USD 4.324.000	Wynn Macau 5,5% 1/10/2027	3.877.763	0,50
				USD 4.665.000	Yuzhou 8,3% 27/5/2025***	239.081	0,03
						115.418.329	14,79
				Chili			
				USD 7.553.000	Banco de Credito e Inversiones 3,5% 12/10/2027*	6.953.820	0,89
				USD 7.535.000	CAP 3,9% 27/4/2031*	5.654.415	0,73
				USD 5.052.000	Embotelladora Andina 3,95% 21/1/2050*	3.852.958	0,49
				USD 2.482.000	Empresa Nacional del Petroleo 3,75% 5/8/2026	2.334.904	0,30
				USD 3.880.000	Empresa Nacional del Petroleo 6,15% 10/5/2033	3.840.541	0,49
				USD 5.512.000	Engie Energia Chile 3,4% 28/1/2030*	4.619.993	0,59
				USD 4.537.000	Engie Energia Chile 4,5% 29/1/2025*	4.394.402	0,57
						31.651.033	4,06
				Colombie			
				USD 3.392.000	Banco Davivienda 6,65% 22/4/2031	2.506.688	0,32
				USD 1.763.000	Ecopetrol 4,125% 16/1/2025	1.708.259	0,22
				USD 2.791.000	Ecopetrol 4,625% 2/11/2031*	2.196.463	0,28
				USD 2.571.000	Ecopetrol 5,875% 2/11/2051	1.726.735	0,22
				USD 3.106.000	Ecopetrol 6,875% 29/4/2030	2.889.356	0,37
				USD 5.186.000	Promigas / Gases del Pacifico 3,75% 16/10/2029	4.374.391	0,56
						15.401.892	1,97
				Guernesey			
				EUR 9.274.000	Globalworth Real Estate Investments 2,95% 29/7/2026*	7.678.246	0,98
				Hong Kong			
				USD 4.311.000	Cathay Pacific MTN Financing HK 4,875% 17/8/2026*	4.142.634	0,53
				USD 2.290.000	Lenovo 3,421% 2/11/2030*	1.909.436	0,25
				USD 571.000	Xiaomi Best Time International 2,875% 14/7/2031*	433.897	0,06
				USD 1.024.000	Xiaomi Best Time International 3,375% 29/4/2030*	834.581	0,11
						7.320.548	0,95
				Hongrie			
				USD 5.285.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6,5% 29/6/2028	5.325.959	0,68
				USD 9.190.000	MVM Energetika Zrt 7,5% 9/6/2028	9.362.313	1,20
						14.688.272	1,88
Argentine							
USD 1.559.517	Aeropuertos Argentina 2000 8,5% 1/8/2031	1.523.453	0,19				
USD 7.968.000	YPF 6,95% 21/7/2027	6.738.498	0,87				
USD 840.103	YPF 7% 30/9/2033	648.803	0,08				
USD 2.844.713	YPF 9% 12/2/2026*	2.805.712	0,36				
		11.716.466	1,50				
Bermudes							
USD 4.822.000	Geopark 5,5% 17/1/2027*	4.120.809	0,53				
USD 9.676.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4,85% 14/10/2038*	8.513.767	1,09				
		12.634.576	1,62				
Brésil							
USD 8.245.000	Banco do Brasil 6,25% 18/4/2030*	8.188.522	1,05				
Îles Vierges britanniques							
USD 9.169.000	Central American Bottling / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 5,25% 27/4/2029	8.393.624	1,08				
USD 6.417.000	Gold Fields Orogen BVI 5,125% 15/5/2024	6.358.702	0,81				
USD 2.195.000	Gold Fields Orogen BVI 6,125% 15/5/2029	2.174.147	0,28				
USD 4.296.000	Huarong Finance 2019 3,375% 24/2/2030*	3.136.080	0,40				
USD 7.975.840	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033*	7.779.554	1,00				
USD 1.417.000	Studio City 7% 15/2/2027	1.345.236	0,17				
USD 1.768.000	Studio City Finance 6,5% 15/1/2028	1.481.469	0,19				
		30.668.812	3,93				
Îles Caïmans							
USD 2.547.000	Baidu 4,375% 29/3/2028*	2.441.198	0,31				
USD 1.914.000	CK Hutchison International 17 3,5% 5/4/2027	1.808.778	0,23				
USD 526.000	CK Hutchison International 19 II 2,75% 6/9/2029	458.522	0,06				
USD 9.710.000	CK Hutchison International 23 4,75% 21/4/2028	9.465.599	1,21				
USD 3.776.000	Dar Al-Arkan Sukuk 7,75% 7/2/2026*	3.789.877	0,49				
USD 7.860.000	Dar Al-Arkan Sukuk 8% 25/2/2029	7.874.148	1,01				
USD 6.314.000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	6.288.321	0,81				
USD 4.247.000	IHS 5,625% 29/11/2026	3.667.454	0,47				
USD 2.250.000	Kaisa 8,5% 30/6/2022***	104.063	0,01				
USD 6.500.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10,875% 15/1/2031	6.539.325	0,84				
USD 2.600.000	Logan 5,25% 23/2/2023***	201.500	0,02				
USD 8.010.000	MAF Global 6,375% 20/3/2026	7.796.253	1,00				
USD 1.986.000	MAF Sukuk 4,638% 14/5/2029	1.935.139	0,25				
USD 10.000.000	Meituan 3,05% 28/10/2030*	7.904.900	1,02				
USD 2.370.000	Melco Resorts Finance 5,625% 17/7/2027*	2.137.941	0,28				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Indonésie				Mexique			
USD 8.431.000	Freeport Indonesia 6,2% 14/4/2052*	7.502.452	0,96	USD 4.000.000	Banco Inbursa Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa 4,125% 6/6/2024*	3.931.540	0,51
USD 4.213.000	Indofood CBP Sukses Makmur 3,398% 9/6/2031	3.502.751	0,45	USD 3.185.000	Banco Mercantil del Norte 6,625% 24/1/2032*	2.577.302	0,33
USD 5.804.000	Indofood CBP Sukses Makmur 4,745% 9/6/2051*	4.252.736	0,54	USD 2.286.000	Banco Mercantil del Norte 7,5% 27/6/2029*	2.093.324	0,27
USD 6.850.000	Pertamina Geothermal Energy 5,15% 27/4/2028*	6.772.938	0,87	USD 3.827.000	Banco Mercantil del Norte 7,625% 10/1/2028*	3.589.114	0,46
USD 9.352.000	Pertamina Persero 1,4% 9/2/2026	8.469.405	1,09	USD 1.061.000	BBVA Bancomer 4,375% 10/4/2024	1.051.340	0,13
		30.500.282	3,91	USD 6.710.000	BBVA Bancomer 5,875% 13/9/2034	5.980.254	0,77
Île de Man				USD 9.946.000	Cemex 5,125% 8/6/2026*	9.229.590	1,19
USD 12.003.000	AngloGold Ashanti 3,375% 1/11/2028	10.405.521	1,33	USD 2.788.000	Cemex 9,125% 14/3/2028*	2.911.006	0,37
Israël				USD 5.186.999	Grupo Posadas 5% 30/12/2027	4.448.708	0,57
USD 4.799.000	Bank Hapoalim 3,255% 21/1/2032*	4.122.989	0,53	USD 9.633.000	Inmobiliaria Vesta 3,625% 13/5/2031	7.942.842	1,02
USD 4.597.000	Bank Leumi Le-Israel 3,275% 29/1/2031	4.141.989	0,53	USD 8.307.000	Metalsa Sapi 3,75% 4/5/2031	6.476.428	0,83
USD 10.084.774	Energian Israel Finance 4,5% 30/3/2024	9.983.926	1,28	USD 9.444.000	Orbia Advance 5,5% 15/1/2048*	7.663.239	0,98
USD 8.405.000	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033	8.520.569	1,09	USD 2.731.000	Petroleos Mexicanos 4,5% 23/1/2026	2.408.551	0,31
USD 7.355.823	Leviathan Bond 6,125% 30/6/2025*	7.225.073	0,93	USD 4.587.000	Trust Fibra Uno 4,869% 15/1/2030	4.007.983	0,51
		33.994.546	4,36			64.311.221	8,25
Jamaïque				Maroc			
USD 147.157	Digicel International Finance/ Digicel international 8% 31/12/2026***	8.737	0,00	USD 9.460.000	OCP 3,75% 23/6/2031*	7.827.138	1,00
USD 7.534	Digicel International Finance/ Digicel international 13% 31/12/2025***	5.387	0,00	Pays-Bas			
		14.124	0,00	USD 7.144.000	Arcos Dorados 6,125% 27/5/2029*	6.892.531	0,88
Kazakhstan				USD 2.333.000	Braskem Netherlands Finance 4,5% 31/1/2030*	1.963.161	0,25
USD 2.700.000	KazMunayGas National JSC 4,75% 19/4/2027	2.542.252	0,33	USD 7.850.000	Embraer Netherlands Finance 7% 28/7/2030*	7.949.695	1,02
USD 3.663.000	KazMunayGas National JSC 5,375% 24/4/2030*	3.343.330	0,43	USD 9.339.000	MEGlobal 2,625% 28/4/2028*	8.247.971	1,06
USD 4.528.000	KazMunayGas National JSC 6,375% 24/10/2048	3.784.842	0,48	USD 3.000.000	Metinvest 7,65% 1/10/2027	1.868.220	0,24
		9.670.424	1,24	USD 9.708.000	Prosus 3,061% 13/7/2031	7.387.982	0,95
Luxembourg				USD 2.075.000	Prosus 4,85% 6/7/2027*	1.958.219	0,25
USD 10.628.000	CSN Resources 4,625% 10/6/2031*	8.079.406	1,04	USD 5.313.000	Prosus 4,987% 19/1/2052*	3.585.744	0,46
USD 6.150.000	Greensaif Pipelines Bidco 6,51% 23/2/2042*	6.221.985	0,80	EUR 4.132.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3,75% 9/5/2027	4.109.269	0,53
USD 2.977.000	Kenbourne Invest 6,875% 26/11/2024*	2.507.229	0,32	USD 7.549.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3,15% 1/10/2026	6.836.903	0,88
USD 7.240.000	MHP Lux 6,25% 19/9/2029	4.013.784	0,52	USD 2.315.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 4,75% 9/5/2027	2.157.256	0,27
USD 8.831.700	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028*	7.954.050	1,02			52.956.951	6,79
USD 3.229.000	Petrorio Luxembourg Trading 6,125% 9/6/2026	3.113.870	0,40	Panama			
USD 4.300.000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	3.959.483	0,51	USD 7.678.632	AES Panama Generation 4,375% 31/5/2030	6.690.008	0,86
USD 2.645.000	TMS Issuer 5,78% 23/8/2032*	2.694.594	0,34	USD 9.346.000	Telecomunicaciones Digitales 4,5% 30/1/2030*	7.950.409	1,02
		38.544.401	4,95			14.640.417	1,88
Maurice				Paraguay			
USD 7.885.000	Diamond II 7,95% 28/7/2026*	7.767.893	1,00	USD 8.791.000	Telefonica Celular del Paraguay 5,875% 15/4/2027	8.278.133	1,06
USD 9.880.657	Greenko Power II 4,3% 13/12/2028*	8.590.444	1,10	Pérou			
USD 8.559.000	Network i2i 5,65% 15/1/2025	8.331.459	1,07	USD 11.171.000	InRetail Consumer 3,25% 22/3/2028	9.664.011	1,24
		24.689.796	3,17	USD 10.190.000	Minsur 4,5% 28/10/2031*	8.792.961	1,13
						18.456.972	2,37

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Corporate Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	270.000	USD	296.940	HSBC Bank	13/9/2023	(3.877)
GBP	510.000	USD	653.879	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(7.352)
USD	2.276.065	EUR	2.110.000	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(14.943)
USD	8.542.240	EUR	7.820.000	BNP Paribas	13/9/2023	54.270
USD	1.724.234	EUR	1.580.657	Citigroup	13/9/2023	8.561
Plus-value nette non réalisée						36.659
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	5.087	USD	5.825	BNY Mellon	15/9/2023	(58)
USD	81	CHF	72	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(58)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	159.248.764	USD	174.741.260	BNY Mellon	15/9/2023	(1.872.037)
USD	2.534.862	EUR	2.328.316	BNY Mellon	15/9/2023	7.418
Moins-value nette non réalisée						(1.864.619)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	665.217	USD	846.407	BNY Mellon	15/9/2023	(3.103)
USD	9.149	GBP	7.178	BNY Mellon	15/9/2023	51
Moins-value nette non réalisée						(3.052)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	12.989.856.272	USD	91.206.916	BNY Mellon	15/9/2023	(2.169.097)
USD	1.145.747	JPY	166.400.557	BNY Mellon	15/9/2023	5.209
Moins-value nette non réalisée						(2.163.888)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 279.605.187)						(3.994.958)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
419	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	85.338.515	232.414
Total				85.338.515	232.414

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 14.506.771	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	(440.448)	256.730
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 14.230.852)					(440.448)	256.730

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

Emerging Markets Equity Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Autres titres négociables			
ACTIONS ORDINAIRES			
Chypre			
551.283	Fix Price**	964.745	0,47
31.096	TCS**	497.536	0,24
		1.462.281	0,71
Fédération de Russie			
197.353	LUKOIL**	20	0,00
350	Novatek**	-	0,00
438.172	Sberbank of Russia**	46	0,00
		66	0,00
Total des actions ordinaires		1.462.347	0,71
Total des autres valeurs mobilières		1.462.347	0,71
Total du portefeuille		196.152.379	95,56
Autres éléments de l'actif net		9.123.467	4,44
Total de l'actif net (USD)		205.275.846	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	1.938.572	USD	1.262.398	BNY Mellon	15/9/2023	(6.172)
USD	302.102	AUD	469.276	BNY Mellon	15/9/2023	(1.996)
Moins-value nette non réalisée						(8.168)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	777.212	USD	577.842	BNY Mellon	15/9/2023	(3.248)
USD	48.666	CAD	65.660	BNY Mellon	15/9/2023	124
Moins-value nette non réalisée						(3.124)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	7.495	USD	8.580	BNY Mellon	15/9/2023	(84)
USD	659	CHF	579	BNY Mellon	15/9/2023	3
Moins-value nette non réalisée						(81)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	59.895	USD	8.298	BNY Mellon	15/9/2023	(62)
USD	639	CNY	4.646	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(62)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	11.384.262	USD	12.487.855	BNY Mellon	15/9/2023	(129.905)
USD	985.357	EUR	903.804	BNY Mellon	15/9/2023	4.254
Moins-value nette non réalisée						(125.651)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	2.992.051	USD	3.805.973	BNY Mellon	15/9/2023	(12.909)
USD	1.248.978	GBP	981.717	BNY Mellon	15/9/2023	4.442
Moins-value nette non réalisée						(8.467)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	22.198.008	USD	2.843.830	BNY Mellon	15/9/2023	(12.002)
USD	218.657	HKD	1.710.288	BNY Mellon	15/9/2023	473
Moins-value nette non réalisée						(11.529)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Equity Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	530.294	USD	320.310	BNY Mellon	15/9/2023	(4.909)
USD	84.659	NZD	142.372	BNY Mellon	15/9/2023	(19)
Moins-value nette non réalisée						(4.928)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	74	SGD	100	BNY Mellon	5/9/2023	-
SGD	1.287.962	USD	956.774	BNY Mellon	15/9/2023	(3.459)
USD	82.957	SGD	112.316	BNY Mellon	15/9/2023	(176)
Moins-value nette non réalisée						(3.635)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 25.054.188)						(165.645)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Égypte			
182.527	Commercial International Bank Egypt	HSBC Bank	37.391
(182.527)	Commercial International Bank Egypt	HSBC Bank	(36.371)
			1.020
Pays-Bas			
212.438	X5 Retail**	JP Morgan	754.155
			754.155
Vietnam			
496.900	Vietnam Dairy Products JSC	HSBC Bank	44.793
			44.793
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 3.032.655)			799.968

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Finance	26,83
Technologie	20,05
Biens de consommation cyclique	14,68
Communications	9,95
Biens de consommation non cyclique	8,86
Matériaux de base	6,19
Énergie	4,32
Valeurs industrielles	3,79
Services aux collectivités	0,89
Autres éléments de l'actif net	4,44
<hr/>	
	100,00

Emerging Markets Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Brésil							
5.282.649	Ambev*	14.976.310	0,60				
7.861.420	Ambev	22.434.607	0,89				
10.433.092	B3 - Brasil Bolsa Balcao	27.571.232	1,10				
3.901.924	Banco Bradesco*	11.783.810	0,47				
8.742.612	Banco Bradesco	26.528.613	1,06				
54.587.185	Hapvida Participacoes e Investimentos	48.750.101	1,95				
14.224.469	Sendas Distribuidora	34.356.995	1,37				
1.148.529	Vale*	15.407.517	0,62				
		201.809.185	8,06				
Canada							
2.172.330	Barrick Gold	35.561.042	1,42				
Îles Caimans							
214.000	Alchip Technologies	16.597.728	0,66				
6.450.800	Alibaba	74.188.940	2,96				
802.002	Alibaba	74.393.705	2,97				
272.803	Baidu*	38.939.900	1,56				
12.715.000	China Mengniu Dairy	42.799.564	1,71				
3.231.400	ENN Energy	25.338.733	1,01				
443.100	New Oriental Education & Technology	2.392.623	0,09				
444.940	New Oriental Education & Technology	24.142.444	0,96				
3.250.566	Pagseguro Digital	29.580.151	1,18				
12.232.800	Sands China	41.410.402	1,65				
802.500	Tencent	33.254.273	1,33				
292.472	Tencent	12.190.233	0,49				
503.489	XP*	12.937.150	0,52				
		428.165.846	17,09				
Chine							
94.448.000	China Construction Bank	50.577.936	2,02				
18.650.000	China Oilfield Services	21.139.740	0,85				
3.918.496	China Oilfield Services	7.982.035	0,32				
54.460	Contemporary Ampere Technology	1.770.706	0,07				
2.637.694	Ganfeng Lithium	17.188.594	0,69				
1.493.800	Ganfeng Lithium*	7.142.377	0,28				
2.176.600	Haier Smart Home*	6.729.913	0,27				
127.854	Kweichow Moutai	32.458.407	1,30				
2.124.376	WuXi AppTec	23.797.700	0,95				
1.110.700	WuXi AppTec*	12.164.912	0,49				
		180.952.320	7,24				
Hong Kong							
2.769.600	Link REIT	13.736.804	0,55				
Hongrie							
913.969	OTP Bank	37.521.101	1,50				
Inde							
12.740.212	Aditya Birla Capital	27.877.687	1,11				
5.680.044	Axis Bank	66.792.762	2,67				
2.409.146	Cipla	36.597.161	1,46				
2.925.269	HDFC Bank	55.527.501	2,22				
922.913	Hindustan Unilever	27.926.654	1,12				
5.112.736	ICICI Prudential Life Insurance	34.825.488	1,39				
784.873	Infosys*	13.696.034	0,55				
1.909.260	Infosys	33.105.099	1,32				
606.476	InterGlobe Aviation	17.838.336	0,71				
266.347	Maruti Suzuki India	32.185.077	1,29				
		346.371.799	13,84				
				Indonésie			
170.112.400	Bank Rakyat Indonesia Persero	61.991.054	2,48				
				Italie			
3.819.500	PRADA	24.958.555	1,00				
				Kazakhstan			
469.083	Kaspi.KZ JSC	48.784.632	1,95				
				Mexique			
101.709	Grupo Aeroportuario del Pacifico	19.682.726	0,79				
1.147.439	Grupo Aeroportuario del Pacifico	22.180.194	0,88				
4.244.112	Grupo Financiero Banorte	37.545.396	1,50				
		79.408.316	3,17				
				Pays-Bas			
192.227	Prosus	13.437.248	0,54				
				Panama			
80.603	Copa	8.361.755	0,33				
				Pologne			
1.077.094	Bank Polska Kasa Opieki	28.240.819	1,13				
564.377	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	5.680.656	0,22				
		33.921.475	1,35				
				Arabie Saoudite			
1.076.288	Saudi Basic Industries	25.367.360	1,01				
				Afrique du Sud			
592.778	Gold Fields*	7.640.908	0,30				
1.332.047	Gold Fields	17.241.462	0,69				
		24.882.370	0,99				
				Corée du Sud			
141.160	Hansol Chemical	17.247.845	0,69				
804.697	Hanwha Solutions	22.191.190	0,89				
56.949	Samsung Biologics	31.754.426	1,27				
3.478.877	Samsung Electronics	176.082.368	7,03				
		247.275.829	9,88				
				Taiwan			
1.969.000	Accton Technology	29.553.678	1,18				
3.012.000	Delta Electronics	32.724.196	1,30				
9.878.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	170.286.135	6,80				
193.730	Taiwan Semiconductor Manufacturing	18.185.435	0,73				
560.000	Wiwynn	27.431.563	1,10				
		278.181.007	11,11				
				Thaïlande			
19.608.900	CP ALL	36.538.310	1,46				
28.331.900	PTT	28.115.461	1,12				
		64.653.771	2,58				
				Émirats arabes unis			
14.123.630	Abu Dhabi Commercial Bank	33.184.060	1,33				
				États-Unis			
572.175	Cognizant Technology Solutions	41.019.226	1,64				
126.114	EPAM Systems	32.531.106	1,30				
		73.550.332	2,94				
Total des actions ordinaires et privilégiées						2.262.075.861	90,36
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé						2.262.075.861	90,36

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Autres titres négociables			
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES			
Chypre			
2.525.354	Fix Price**	4.419.370	0,18
411.323	TCS**	4.878.427	0,19
		9.297.797	0,37
Fédération de Russie			
1.013.604	Gazprom**	106	0,00
1.056.549	LUKOIL**	110	0,00
190.106	Novatek**	20	0,00
1.732.056	Sberbank of Russia**	180	0,00
64.838.702	Surgutneftgas**	6.757	0,00
		7.173	0,00
États-Unis			
19.672	Sequoia Pine Investment**	9.364.265	0,37
Total des actions ordinaires et privilégiées		18.669.235	0,74
Total des autres valeurs mobilières		18.669.235	0,74
Total du portefeuille		2.280.745.096	91,10
Autres éléments de l'actif net		222.718.974	8,90
Total de l'actif net (USD)		2.503.464.070	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	2.909.789	USD	3.191.680	BNY Mellon	15/9/2023	(33.021)
USD	296.618	EUR	272.013	BNY Mellon	15/9/2023	1.343
Moins-value nette non réalisée						(31.678)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 3.452.099)						(31.678)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Moins-value non réalisée USD
810	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	39.904.650	(1.449.309)
Total				39.904.650	(1.449.309)

Emerging Markets Fund suite

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Îles Caïmans			
5.657	Pagseguro Digital	Goldman Sachs	5.091
			5.091
Chine			
872.380	Asymchem Laboratories Tianjin	Goldman Sachs	638.016
1.329.737	Contemporary Amperex Technology	Goldman Sachs	1.089.822
6.699.120	Haier Smart Home	Goldman Sachs	131.792
			1.859.630
Égypte			
1.764.199	Commercial International Bank Egypt	HSBC Bank	361.403
(1.764.199)	Commercial International Bank Egypt	HSBC Bank	(348.813)
			12.590
Jersey			
928.932	Wizz Air	HSBC Bank	(535.920)
			(535.920)
Pays-Bas			
221.700	Prosus	JP Morgan	(580.233)
			(580.233)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 129.809.190)			761.158

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Technologie	23,07
Finance	23,02
Biens de consommation non cyclique	12,79
Communications	11,03
Biens de consommation cyclique	8,33
Matériaux de base	6,59
Valeurs industrielles	2,97
Énergie	2,29
Services aux collectivités	1,01
Autres éléments de l'actif net	8,90
	100,00

Emerging Markets Impact Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
Autriche				Hong Kong			
USD 1.733.000	Klabin Austria 7% 3/4/2049	1.679.485	1,82	USD 1.896.000	Lenovo 6,536% 27/7/2032	1.909.111	2,07
USD 2.633.000	Suzano Austria 5,75% 14/7/2026	2.632.934	2,85	USD 2.714.000	Xiaomi Best Time International 4,1% 14/7/2051	1.623.501	1,76
		4.312.419	4,67			3.532.612	3,83
Bénin				Hongrie			
EUR 1.142.000	Benin Government International Bond 4,95% 22/1/2035	874.962	0,95	EUR 2.030.000	Hungary Government International Bond 1,75% 5/6/2035	1.539.196	1,67
Bermudes				Inde			
USD 2.706.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4,85% 14/10/2038	2.380.969	2,58	USD 987.000	JSW Hydro Energy 4,125% 18/5/2031	833.048	0,90
Brésil				Indonésie			
USD 2.675.000	Banco do Brasil 6,25% 18/4/2030	2.656.676	2,88	USD 1.388.000	Power Finance 3,75% 6/12/2027	1.281.006	1,39
						2.114.054	2,29
Îles Vierges britanniques				International			
USD 1.886.732	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033	1.840.299	2,00	USD 1.792.000	Pertamina Geothermal Energy 5,15% 27/4/2028	1.771.840	1,92
Îles Caïmans				Luxembourg			
USD 2.300.000	Baidu 2,375% 23/8/2031*	1.828.557	1,98	USD 2.000.000	Arab Petroleum Investments 1,483% 6/10/2026	1.787.250	1,94
USD 2.300.000	Banco Bradesco 4,375% 18/3/2027*	2.190.198	2,37	EUR 400.000	Banque Ouest Africaine de Développement 2,75% 22/1/2033	317.689	0,34
USD 1.768.000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	1.748.517	1,90			2.104.939	2,28
USD 800.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands 2,25% 15/7/2031	640.536	0,69	Maurice			
USD 1.000.000	MAF Sukuk 3,933% 28/2/2030	929.125	1,01	USD 918.000	Diamond II 7,95% 28/7/2026	904.366	0,98
USD 1.011.000	MAF Sukuk 4,638% 14/5/2029	985.108	1,07	USD 630.700	Greenko Power II 4,3% 13/12/2028	548.344	0,59
USD 500.000	MAF Sukuk 5% 1/6/2033*	494.228	0,54	USD 755.000	Greenko Wind Projects Mauritius 5,5% 6/4/2025	728.001	0,79
USD 880.000	Saudi Electricity Sukuk Programme 4,632% 11/4/2033*	859.818	0,93			2.180.711	2,36
		9.676.087	10,49	Mexique			
Chili				Pays-Bas			
USD 1.348.000	Celulosa Arauco y Constitucion 4,2% 29/1/2030	1.196.390	1,30	USD 658.000	Greenko Dutch 3,85% 29/3/2026	595.635	0,65
USD 2.950.000	Chile Government International Bond 2,75% 31/1/2027	2.743.057	2,97	Paraguay			
USD 2.739.000	Colbun 3,15% 19/1/2032*	2.276.479	2,47	USD 2.345.000	Banco Continental SAECA 2,75% 10/12/2025	2.129.910	2,31
USD 3.044.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones 3,05% 14/9/2032	2.373.133	2,57	Pérou			
USD 2.206.000	Interchile 4,5% 30/6/2056	1.720.393	1,86	USD 3.209.000	Fondo MIVIVIENDA 4,625% 12/4/2027*	3.082.838	3,34
USD 1.836.000	Inversiones CMPC 4,375% 4/4/2027*	1.745.825	1,89	USD 1.215.000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034	986.945	1,07
		12.055.277	13,06			4.069.783	4,41
Chine				Géorgie			
USD 1.989.000	Industrial & Commercial Bank of China 1,625% 28/10/2026	1.783.831	1,93	USD 2.040.000	Georgian Railway JSC 4% 17/6/2028	1.772.026	1,92
Égypte							
USD 900.000	Egypt Government International Bond 5,25% 6/10/2025	700.767	0,76				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Local Currency Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				CNY 55.330.000	China Government Bond 3,29% 23/5/2029	7.938.441	0,49
				CNY 19.970.000	China Government Bond 3,72% 12/4/2051	3.150.741	0,19
				CNY 61.070.000	China Government Bond 3,81% 14/9/2050	9.750.285	0,60
				76.785.207			
OBLIGATIONS							
Brésil				Colombie			
BRL 52.341.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/1/2024	10.233.147	0,63	USD 8.739.000	Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031	6.739.954	0,41
BRL 79.576.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2024	14.806.023	0,91	USD 3.953.000	Colombia Government International Bond 7,5% 2/2/2034*	3.921.673	0,24
BRL 44.728.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2025	7.598.223	0,47	COP 393.000.000	Colombia Government International Bond 9,85% 28/6/2027	94.214	0,01
BRL 188.452.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/1/2026	30.485.565	1,87	COP 67.092.800.000	Colombian TES 6% 28/4/2028	14.015.245	0,86
BRL 34.210.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2026	5.287.915	0,32	COP 26.051.600.000	Colombian TES 6,25% 26/11/2025	5.936.104	0,36
BRL 132.180.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	26.806.529	1,65	COP 13.416.100.000	Colombian TES 7% 26/3/2031	2.709.121	0,17
BRL 157.527.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	31.725.058	1,95	COP 84.896.400.000	Colombian TES 7% 26/3/2031	17.224.873	1,06
BRL 174.897.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2029	34.567.308	2,12	COP 56.551.900.000	Colombian TES 7% 30/6/2032	11.123.409	0,68
BRL 119.681.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2031	23.581.704	1,45	COP 60.569.500.000	Colombian TES 7,25% 18/10/2034	11.579.622	0,71
BRL 36.431.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2033	7.073.759	0,43	COP 51.089.600.000	Colombian TES 7,25% 26/10/2050	8.548.152	0,53
				COP 52.211.100.000	Colombian TES 7,5% 26/8/2026	11.980.396	0,74
				COP 56.595.600.000	Colombian TES 7,75% 18/9/2030	12.206.021	0,75
				COP 40.139.700.000	Colombian TES 9,25% 28/5/2042	8.488.114	0,52
				114.566.898			
				République tchèque			
CLP 8.650.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 2,3% 1/10/2028	8.738.322	0,54	CZK 40.330.000	Czech Republic Government Bond 0% 12/12/2024	1.698.839	0,10
CLP 5.745.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,5% 1/3/2026	6.527.645	0,40	CZK 137.390.000	Czech Republic Government Bond 0,05% 29/11/2029*	4.761.421	0,29
CLP 3.245.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,7% 1/9/2030	3.582.056	0,22	CZK 242.220.000	Czech Republic Government Bond 0,95% 15/5/2030*	8.793.985	0,54
USD 8.911.000	Chile Government International Bond 2,55% 27/1/2032*	7.495.309	0,46	CZK 121.910.000	Czech Republic Government Bond 1% 26/6/2026	4.973.158	0,31
USD 5.418.000	Chile Government International Bond 4,34% 7/3/2042*	4.659.643	0,28	CZK 292.970.000	Czech Republic Government Bond 1,2% 13/3/2031*	10.608.756	0,65
				CZK 133.890.000	Czech Republic Government Bond 1,25% 14/2/2025	5.697.698	0,35
				CZK 277.680.000	Czech Republic Government Bond 1,75% 23/6/2032	10.250.954	0,63
				CZK 308.880.000	Czech Republic Government Bond 2% 13/10/2033	11.330.935	0,70
				CZK 60.340.000	Czech Republic Government Bond 2,5% 25/8/2028	2.486.133	0,15
				CZK 225.380.000	Czech Republic Government Bond 2,75% 23/7/2029	9.302.181	0,57
				CZK 60.570.000	Czech Republic Government Bond 4,2% 4/12/2036	2.678.415	0,17
				CZK 95.820.000	Czech Republic Government Bond 6% 26/2/2026	4.457.680	0,27
				77.040.155			
				République dominicaine			
CNY 39.020.000	China Government Bond 1,99% 9/4/2025	5.339.001	0,33	USD 6.115.000	Dominican Republic International Bond 5,5% 22/2/2029	5.725.108	0,35
CNY 61.410.000	China Government Bond 2,68% 21/5/2030	8.491.937	0,52	DOP 107.700.000	Dominican Republic International Bond 13,625% 3/2/2033	2.317.198	0,14
CNY 44.810.000	China Government Bond 2,85% 4/6/2027	6.258.647	0,38				
CNY 32.700.000	China Government Bond 2,88% 25/2/2033	4.590.077	0,28				
CNY 36.170.000	China Government Bond 3,02% 22/10/2025	5.064.446	0,31				
CNY 1.820.000	China Government Bond 3,12% 5/12/2026	257.287	0,02				
CNY 59.850.000	China Government Bond 3,13% 21/11/2029	8.521.557	0,52				
CNY 60.360.000	China Government Bond 3,25% 22/11/2028	8.638.179	0,53				
CNY 59.140.000	China Government Bond 3,27% 19/11/2030	8.537.702	0,53				
CNY 1.730.000	China Government Bond 3,28% 3/12/2027	246.907	0,02				
				8.042.306			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Local Currency Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Égypte				IDR 141.385.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/9/2026	9.826.396	0,60
EGP 79.711.000	Egypt Government Bond 14,664% 6/10/2030	1.420.511	0,09	IDR 155.569.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/3/2034	11.649.799	0,71
EGP 58.045.000	Egypt Government Bond 14,82% 6/7/2031	1.026.366	0,06	IDR 104.642.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/4/2039	7.987.283	0,49
USD 11.377.000	Egypt Government International Bond 8,875% 29/5/2050	6.122.646	0,38	IDR 80.695.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,75% 15/5/2031	6.032.256	0,37
		8.569.523	0,53	IDR 84.186.000.000	Indonesia Treasury Bond 9% 15/3/2029	6.213.070	0,38
Hongrie				IDR 61.927.000.000	Indonesia Treasury Bond 9,5% 15/7/2031	4.824.450	0,30
HUF 1.322.270.000	Hungary Government Bond 1% 26/11/2025	3.228.163	0,20	IDR 143.955.000.000	Indonesia Treasury Bond 11% 15/9/2025	10.302.754	0,63
HUF 663.140.000	Hungary Government Bond 1,5% 22/4/2026	1.605.573	0,10			170.251.025	10,46
HUF 1.140.440.000	Hungary Government Bond 2,75% 22/12/2026	2.780.701	0,17	Malaisie			
HUF 991.810.000	Hungary Government Bond 3% 27/10/2027*	2.411.892	0,15	MYR 12.253.000	Malaysia Government Bond 2,632% 15/4/2031	2.435.071	0,15
HUF 3.082.650.000	Hungary Government Bond 3% 21/8/2030	6.967.736	0,43	MYR 50.173.000	Malaysia Government Bond 3,502% 31/5/2027	10.798.163	0,66
HUF 2.002.960.000	Hungary Government Bond 3,25% 22/10/2031*	4.495.734	0,27	MYR 63.756.000	Malaysia Government Bond 3,582% 15/7/2032	13.464.392	0,83
HUF 3.093.360.000	Hungary Government Bond 4% 28/4/2051	5.562.650	0,34	MYR 38.263.000	Malaysia Government Bond 3,733% 15/6/2028	8.278.450	0,51
HUF 2.672.150.000	Hungary Government Bond 4,75% 24/11/2032	6.485.959	0,40	MYR 31.556.000	Malaysia Government Bond 3,757% 22/5/2040	6.500.362	0,40
HUF 1.912.570.000	Hungary Government Bond 5,5% 24/6/2025	5.155.605	0,32	MYR 40.645.000	Malaysia Government Bond 3,828% 5/7/2034	8.664.299	0,53
HUF 19.420.000	Hungary Government Bond 6% 24/11/2023	54.849	0,00	MYR 15.744.000	Malaysia Government Bond 3,844% 15/4/2033	3.384.618	0,21
HUF 2.382.130.000	Hungary Government Bond 6,75% 22/10/2028*	6.658.344	0,41	MYR 8.979.000	Malaysia Government Bond 3,882% 14/3/2025	1.952.457	0,12
USD 8.514.000	Hungary Government International Bond 6,25% 22/9/2032*	8.593.052	0,53	MYR 51.580.000	Malaysia Government Bond 3,885% 15/8/2029	11.217.253	0,69
		54.000.258	3,32	MYR 24.842.000	Malaysia Government Bond 3,892% 15/3/2027	5.414.374	0,33
Inde				MYR 20.884.000	Malaysia Government Bond 3,899% 16/11/2027	4.561.418	0,28
INR 42.120.000	India Government Bond 6,79% 15/5/2027	502.186	0,03	MYR 59.020.000	Malaysia Government Bond 3,955% 15/9/2025	12.857.702	0,79
INR 49.600.000	India Government Bond 7,17% 8/1/2028	598.858	0,04	MYR 19.635.000	Malaysia Government Bond 4,059% 30/9/2024	4.263.797	0,26
		1.101.044	0,07	MYR 21.211.000	Malaysia Government Bond 4,065% 15/6/2050	4.404.662	0,27
Indonésie				MYR 27.954.000	Malaysia Government Bond 4,232% 30/6/2031	6.182.981	0,38
IDR 112.721.000.000	Indonesia Treasury Bond 5,5% 15/4/2026	7.286.528	0,45	MYR 47.216.000	Malaysia Government Bond 4,392% 15/4/2026	10.414.479	0,64
IDR 97.927.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,125% 15/5/2028	6.394.511	0,39	MYR 15.451.000	Malaysia Government Bond 4,457% 31/3/2053	3.440.492	0,21
IDR 376.062.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,375% 15/4/2032	24.704.531	1,52	MYR 17.631.000	Malaysia Government Bond 4,498% 15/4/2030	3.966.972	0,24
IDR 122.390.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,5% 15/2/2031	8.088.347	0,50	MYR 24.109.000	Malaysia Government Bond 4,504% 30/4/2029	5.401.555	0,33
IDR 84.479.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	5.688.326	0,35	MYR 19.411.000	Malaysia Government Bond 4,696% 15/10/2042	4.485.277	0,28
IDR 307.735.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/2/2033	21.105.002	1,30	MYR 25.793.000	Malaysia Government Bond 4,736% 15/3/2046	5.947.951	0,37
IDR 31.681.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2038	2.208.101	0,13	MYR 17.393.000	Malaysia Government Bond 4,762% 7/4/2037	4.028.389	0,25
IDR 56.569.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2042	3.890.744	0,24	MYR 35.468.000	Malaysia Government Bond 4,893% 8/6/2038	8.367.270	0,51
IDR 110.720.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,5% 15/8/2032	7.789.657	0,48	MYR 389.000	Malaysia Government Investment Issue 4,128% 15/8/2025	85.073	0,00
IDR 50.052.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,5% 15/5/2038	3.544.391	0,22			150.517.457	9,24
IDR 88.260.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/6/2032	6.487.660	0,40	Mexique			
IDR 217.471.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2036	16.227.219	1,00	MXN 146.083.900	Mexican Bonos 5,5% 4/3/2027	7.640.874	0,47
				MXN 494.702.580	Mexican Bonos 5,75% 5/3/2026	26.752.169	1,64

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Local Currency Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
ZAR 151.515.279	Republic of South Africa Government Bond 6,5% 28/2/2041	4.765.283	0,29	USD 6.231.000	États-Unis United States Treasury Note/ Bond 0,125% 15/1/2024	6.111.359	0,38
ZAR 962.269.710	Republic of South Africa Government Bond 7% 28/2/2031*	41.594.614	2,55	USD 18.078.400	United States Treasury Note/ Bond 0,375% 15/7/2024	17.310.800	1,06
ZAR 521.629.189	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030*	24.910.266	1,53	USD 8.680.000	United States Treasury Note/ Bond 2,125% 30/11/2024	8.352.466	0,51
ZAR 363.904.066	Republic of South Africa Government Bond 8,25% 31/3/2032*	16.455.085	1,01	USD 17.124.900	United States Treasury Note/ Bond 4,63% 30/6/2025*†	17.018.538	1,05
ZAR 357.064.225	Republic of South Africa Government Bond 8,5% 31/1/2037	14.576.659	0,89	UYU 149.670.000	Uruguay Uruguay Government International Bond 8,5% 15/3/2028	3.862.698	0,24
ZAR 258.651.345	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 31/1/2044*	10.018.714	0,62	ZMW 55.000.000	Zambie Zambia Government Bond 13% 18/12/2027	2.049.734	0,12
ZAR 436.282.994	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048*	16.803.184	1,03		Total des obligations	1.570.560.757	96,47
ZAR 326.332.799	Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035*	14.323.683	0,88		Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	1.570.560.757	96,47
ZAR 198.921.788	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	8.111.168	0,50		Autres titres négociables		
ZAR 429.222.324	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026	23.901.851	1,47		OBLIGATIONS		
		179.979.596	11,05	GHS 58.473.000	Ghana Ghana Treasury Note 17,6% 20/2/2023**,**	2.564.598	0,16
				GHS 12.800.000	Republic of Ghana Government Bonds 20,75% 6/3/2023**,**	561.402	0,03
						3.126.000	0,19
	Suède				Ukraine		
EUR 9.731.813	East Renewable 13,5% 1/1/2025	1.319.811	0,08	UAH 224.880.000	Ukraine Government International Bond 16% 24/5/2023**,**	6.099.758	0,38
	Ukraine				Total des obligations	9.225.758	0,57
UAH 80.000.000	Ukraine Government International Bond 10% 23/8/2023***	1.584.071	0,10		Total des autres valeurs mobilières	9.225.758	0,57
UAH 40.626.000	Ukraine Government International Bond 15,84% 26/2/2025	800.254	0,05		Total du portefeuille	1.579.786.515	97,05
		2.384.325	0,15		Autres éléments de l'actif net	48.093.260	2,95
					Total de l'actif net (USD)	1.627.879.775	100,00

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	6.792.400	USD	4.534.684	JP Morgan	13/9/2023	(133.438)
AUD	12.500.000	USD	8.197.449	Bank of America	13/9/2023	(97.871)
BRL	76.310.900	USD	15.800.642	JP Morgan	5/9/2023	(314.327)
BRL	17.700.000	USD	3.628.566	HSBC Bank	5/9/2023	(36.579)
BRL	44.500.000	USD	9.043.777	BNP Paribas	5/9/2023	(13.076)
BRL	30.490.000	USD	6.134.829	BNY Mellon	5/9/2023	52.724
BRL	40.946.355	USD	8.168.686	Bank of America	5/9/2023	140.849
BRL	160.668.854	USD	32.644.461	Goldman Sachs	3/10/2023	(187.360)
BRL	205.453.551	USD	41.928.354	Goldman Sachs	5/9/2023	(234.204)
CAD	11.465.200	USD	8.593.826	JP Morgan	13/9/2023	(117.850)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Local Currency Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
CAD	11.400.000	USD	8.663.206	Bank of America	13/9/2023	(235.431)
CAD	7.400.000	USD	5.547.751	BNP Paribas	13/9/2023	(77.090)
CHF	2.057.900	USD	2.311.234	Toronto-Dominion	13/9/2023	21.071
CHF	3.134.600	USD	3.639.605	BNP Paribas	13/9/2023	(87.030)
CLP	5.218.183.682	USD	6.467.353	JP Morgan	13/9/2023	(366.549)
CLP	6.857.424.912	USD	8.315.018	Morgan Stanley	13/9/2023	(297.706)
CLP	12.310.369.400	USD	15.082.581	Bank of America	13/9/2023	(689.997)
CLP	4.690.171.088	USD	5.735.599	Barclays	13/9/2023	(252.117)
CLP	3.266.400.000	USD	3.940.929	BNP Paribas	13/9/2023	(122.040)
CLP	5.465.679.900	USD	6.481.905	Goldman Sachs	13/9/2023	(91.742)
CNH	683.035.693	USD	94.758.833	Bank of America	13/9/2023	(831.588)
CNH	13.300.000	USD	1.861.182	Morgan Stanley	13/9/2023	(32.241)
CNH	14.300.000	USD	1.994.914	JP Morgan	13/9/2023	(28.458)
CNH	17.000.000	USD	2.368.437	BNP Paribas	13/9/2023	(30.692)
COP	47.803.050.000	USD	11.413.893	Morgan Stanley	13/9/2023	192.647
COP	13.494.300.000	USD	3.156.387	Barclays	13/9/2023	120.017
COP	116.165.642.652	USD	28.230.731	BNY Mellon	13/9/2023	(25.814)
COP	30.762.154.300	USD	7.264.133	BNP Paribas	13/9/2023	204.892
COP	11.755.448.769	USD	2.918.433	Goldman Sachs	13/9/2023	(64.220)
COP	15.680.300.000	USD	3.844.153	JP Morgan	13/9/2023	(36.990)
COP	21.766.300.000	USD	5.171.371	Bank of America	13/9/2023	113.468
CZK	883.132.489	USD	40.244.974	HSBC Bank	13/9/2023	(429.844)
CZK	7.920.000	USD	361.102	Barclays	13/9/2023	(4.037)
CZK	69.082.000	USD	3.198.109	Morgan Stanley	13/9/2023	(83.618)
CZK	267.250.000	USD	12.167.212	Citigroup	13/9/2023	(118.518)
CZK	112.416.600	USD	5.207.655	JP Morgan	13/9/2023	(139.467)
CZK	88.735.400	USD	4.069.250	Toronto-Dominion	13/9/2023	(68.705)
CZK	13.650.000	USD	625.064	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(9.667)
CZK	11.100.000	USD	496.643	UBS	13/9/2023	3.789
EUR	78.923.973	USD	86.412.404	Morgan Stanley	13/9/2023	(746.896)
EUR	61.560.600	USD	67.636.961	JP Morgan	13/9/2023	(817.970)
EUR	42.713.800	USD	47.000.299	HSBC Bank	13/9/2023	(637.966)
EUR	14.788.000	USD	16.042.673	Barclays	13/9/2023	8.490
EUR	330.000	USD	356.950	BNY Mellon	13/9/2023	1.238
EUR	15.007.000	USD	16.179.512	Bank of America	13/9/2023	109.358
GBP	6.683.600	USD	8.543.856	JP Morgan	13/9/2023	(71.044)
HUF	13.394.686.238	USD	37.641.383	Toronto-Dominion	13/9/2023	501.030
HUF	2.170.650.300	USD	6.071.123	Goldman Sachs	13/9/2023	109.973
HUF	4.079.507.200	USD	11.618.859	JP Morgan	13/9/2023	(2.145)
HUF	1.480.610.400	USD	4.276.057	Citibank	13/9/2023	(59.904)
HUF	1.482.199.800	USD	4.268.148	BNP Paribas	13/9/2023	(47.469)
IDR	71.385.099.895	USD	4.679.860	Bank of America	13/9/2023	6.787
IDR	48.343.086.034	USD	3.176.600	BNP Paribas	13/9/2023	(2.731)
IDR	478.172.279.200	USD	31.687.397	HSBC Bank	13/9/2023	(293.946)
IDR	51.475.900.000	USD	3.430.126	JP Morgan	13/9/2023	(50.578)
IDR	18.900.400.000	USD	1.233.788	Standard Chartered Bank	13/9/2023	7.080
ILS	32.346.600	USD	8.758.172	UBS	13/9/2023	(271.227)
ILS	8.600.000	USD	2.335.804	Morgan Stanley	13/9/2023	(79.377)
INR	2.643.003.472	USD	31.972.461	Morgan Stanley	13/9/2023	(47.495)
INR	361.570.000	USD	4.359.811	UBS	13/9/2023	7.611
INR	445.300.000	USD	5.387.017	BNP Paribas	13/9/2023	(8.217)
INR	300.089.000	USD	3.619.604	JP Morgan	13/9/2023	5.186
JPY	11.986.310.722	USD	84.166.455	Morgan Stanley	13/9/2023	(2.037.169)
JPY	558.100.000	USD	4.047.045	JP Morgan	13/9/2023	(222.986)
JPY	2.972.900.000	USD	21.477.388	Bank of America	13/9/2023	(1.107.304)
KZT	2.087.178.100	USD	4.450.273	Goldman Sachs	31/10/2023	26.312
MXN	133.731.400	USD	7.685.748	Barclays	13/9/2023	292.668
MXN	78.701.400	USD	4.483.082	HSBC Bank	13/9/2023	212.244

Emerging Markets Local Currency Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
MXN	47.731.800	USD	2.803.001	Morgan Stanley	13/9/2023	44.679
MXN	86.340.000	USD	5.091.443	BNY Mellon	13/9/2023	59.602
MXN	252.994.100	USD	14.776.137	Deutsche Bank	13/9/2023	317.491
MXN	73.900.000	USD	4.237.998	Goldman Sachs	13/9/2023	170.876
MYR	39.236.000	USD	8.429.322	Morgan Stanley	13/9/2023	32.185
MYR	19.301.900	USD	4.129.190	State Street	13/9/2023	33.394
MYR	126.792.737	USD	27.290.731	Goldman Sachs	13/9/2023	52.974
NGN	3.972.200.000	USD	5.441.370	Standard Chartered Bank	18/9/2023	(329.485)
NOK	136.359.700	USD	12.786.932	State Street	13/9/2023	21.796
NOK	49.686.600	USD	4.657.082	Deutsche Bank	13/9/2023	10.149
NZD	13.800.000	USD	8.604.783	Morgan Stanley	13/9/2023	(397.063)
PEN	55.323.400	USD	15.150.087	Bank of America	13/9/2023	(152.804)
PEN	25.266.200	USD	7.012.506	Morgan Stanley	13/9/2023	(163.246)
PEN	19.000.000	USD	5.171.053	JP Morgan	13/9/2023	(20.459)
PHP	421.439.400	USD	7.625.027	JP Morgan	13/9/2023	(183.447)
PHP	276.700.000	USD	5.038.604	BNP Paribas	13/9/2023	(152.765)
PLN	195.036.786	USD	47.308.022	Bank of America	13/9/2023	17.991
PLN	29.611.000	USD	7.289.422	Goldman Sachs	13/9/2023	(104.261)
PLN	32.400.000	USD	8.163.101	Citigroup	13/9/2023	(301.185)
PLN	29.756.900	USD	7.381.916	Morgan Stanley	13/9/2023	(161.352)
PLN	32.083.000	USD	7.768.469	Deutsche Bank	13/9/2023	16.527
RON	187.842.700	USD	41.236.104	Goldman Sachs	13/9/2023	5.771
RON	27.007.800	USD	6.064.697	Deutsche Bank	13/9/2023	(134.989)
RON	60.949.800	USD	13.482.288	BNP Paribas	13/9/2023	(100.432)
RON	2.060.000	USD	464.847	Barclays	13/9/2023	(12.563)
THB	7.085.017.600	USD	200.501.402	Standard Chartered Bank	13/9/2023	2.007.241
THB	125.351.000	USD	3.542.590	Goldman Sachs	13/9/2023	40.275
THB	818.087.600	USD	23.515.022	Bank of America	13/9/2023	(131.903)
THB	273.419.700	USD	8.033.486	Morgan Stanley	13/9/2023	(218.424)
THB	152.400.000	USD	4.358.292	JP Morgan	13/9/2023	(2.294)
TRY	495.750.000	USD	18.595.794	UBS	29/9/2023	(318.248)
TWD	226.250.100	USD	7.248.168	HSBC Bank	13/9/2023	(143.108)
TWD	279.300.000	USD	8.899.495	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(128.480)
USD	10.621.701	TRY	271.650.000	UBS	29/9/2023	606.380
USD	11.157.729	MYR	51.521.134	Morgan Stanley	13/9/2023	46.850
USD	10.114.029	MYR	46.946.026	Barclays	13/9/2023	(10.197)
USD	22.556.592	THB	788.323.800	Standard Chartered Bank	13/9/2023	24.201
USD	4.470.824	AUD	6.685.800	Deutsche Bank	13/9/2023	138.651
USD	66.381.478	ZAR	1.259.018.788	Morgan Stanley	13/9/2023	(570.157)
USD	23.515.015	THB	818.087.359	Bank of America	13/9/2023	131.903
USD	97.275.663	COP	410.802.170.090	Goldman Sachs	13/9/2023	(2.466.751)
USD	13.922.722	PHP	774.033.731	Standard Chartered Bank	13/9/2023	255.196
USD	7.538.238	JPY	1.071.885.100	JP Morgan	13/9/2023	193.763
USD	23.342.830	PLN	95.182.600	Bank of America	13/9/2023	246.608
USD	8.544.467	CAD	11.338.600	HSBC Bank	13/9/2023	162.084
USD	5.120.298	IDR	77.461.404.808	HSBC Bank	13/9/2023	34.723
USD	25.461.652	CHF	22.670.800	Toronto-Dominion	13/9/2023	(232.129)
USD	5.484.766	CLP	4.425.383.005	JP Morgan	13/9/2023	310.860
USD	77.870.475	RON	354.723.140	Goldman Sachs	13/9/2023	(10.898)
USD	63.755.302	EUR	58.369.582	Morgan Stanley	13/9/2023	399.901
USD	86.051.405	MXN	1.485.591.456	Bank of America	13/9/2023	(2.578.987)
USD	33.516.146	PEN	122.786.400	JP Morgan	13/9/2023	230.730
USD	70.628.151	EUR	64.478.300	HSBC Bank	13/9/2023	642.237
USD	103.629.046	JPY	14.460.239.300	Bank of America	13/9/2023	4.548.591
USD	8.385.045	HUF	2.982.928.000	BNP Paribas	13/9/2023	(109.075)
USD	2.824.959	AUD	4.247.784	Goldman Sachs	13/9/2023	72.538
USD	16.616.092	CZK	364.791.000	Citigroup	13/9/2023	169.862
USD	20.351.057	RON	92.148.000	Société Générale	13/9/2023	119.468

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Local Currency Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	3.005.329	GBP	2.348.846	Morgan Stanley	13/9/2023	27.693
USD	5.355.858	CHF	4.734.142	JP Morgan	13/9/2023	(9.547)
USD	2.845.932	CAD	3.779.193	Standard Chartered Bank	13/9/2023	52.056
USD	17.660.774	CNH	128.100.000	JP Morgan	13/9/2023	45.179
USD	16.771.522	EUR	15.234.000	Westpac	13/9/2023	236.262
USD	13.479.807	COP	55.215.241.000	Bank of America	13/9/2023	73.593
USD	19.354.766	HUF	6.767.378.071	Citigroup	13/9/2023	84.130
USD	4.763.955	HUF	1.676.530.829	Morgan Stanley	13/9/2023	(10.098)
USD	10.023.530	ZAR	188.413.000	Citigroup	13/9/2023	4.174
USD	9.766.362	CZK	212.251.400	Deutsche Bank	13/9/2023	197.223
USD	11.885.993	TWD	370.944.000	Standard Chartered Bank	13/9/2023	237.029
USD	33.708.184	EUR	30.509.700	Goldman Sachs	13/9/2023	592.404
USD	14.923.622	ZAR	279.491.500	JP Morgan	13/9/2023	60.927
USD	10.835.772	THB	374.701.000	Morgan Stanley	13/9/2023	125.821
USD	18.447.004	HUF	6.435.539.400	JP Morgan	13/9/2023	121.305
USD	11.205.693	PLN	45.438.300	Goldman Sachs	13/9/2023	180.011
USD	13.728.551	HUF	4.822.775.800	Deutsche Bank	13/9/2023	(4.679)
USD	11.288.215	IDR	170.260.578.300	JP Morgan	13/9/2023	110.095
USD	18.260.891	NOK	186.074.900	Deutsche Bank	13/9/2023	782.247
USD	8.097.324	INR	666.927.500	JP Morgan	13/9/2023	41.475
USD	4.096.416	PHP	225.139.000	Morgan Stanley	13/9/2023	121.016
USD	50.775	INR	4.173.060	HSBC Bank	13/9/2023	368
USD	9.675.425	IDR	146.185.991.900	Deutsche Bank	13/9/2023	77.874
USD	3.031.722	IDR	45.784.030.000	Bank of America	13/9/2023	25.862
USD	14.030.816	ZAR	258.872.100	Deutsche Bank	13/9/2023	264.612
USD	12.366.087	INR	1.016.226.940	BNP Paribas	13/9/2023	91.033
USD	681.007	EUR	610.000	BNY Mellon	13/9/2023	18.902
USD	2.934.981	NZD	4.620.000	Barclays	13/9/2023	187.179
USD	4.580.396	THB	157.610.900	Goldman Sachs	13/9/2023	75.457
USD	6.681.362	COP	27.847.917.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(80.088)
USD	11.529.788	ZAR	213.089.200	Standard Chartered Bank	13/9/2023	198.209
USD	1.058.668	CNH	7.550.000	Goldman Sachs	13/9/2023	20.434
USD	1.734.694	IDR	25.973.573.262	Morgan Stanley	13/9/2023	29.451
USD	1.000.000	COP	4.150.630.000	BNP Paribas	13/9/2023	(7.769)
USD	519.679	MXN	8.800.000	Barclays	13/9/2023	(5.329)
USD	24.895.260	EUR	22.585.000	JP Morgan	13/9/2023	381.092
USD	4.463.028	ZAR	84.640.000	State Street	13/9/2023	(37.926)
USD	6.043.979	CZK	132.423.000	Morgan Stanley	13/9/2023	73.823
USD	3.966.480	PEN	14.200.000	Morgan Stanley	13/9/2023	117.089
USD	13.188.958	PLN	52.865.800	Toronto-Dominion	13/9/2023	360.979
USD	11.041.173	COP	44.660.614.300	Barclays	13/9/2023	197.614
USD	8.329.289	CZK	177.300.000	Goldman Sachs	13/9/2023	335.899
USD	7.466.602	PLN	29.600.000	Société Générale	13/9/2023	284.111
USD	33.900	MXN	580.000	HSBC Bank	13/9/2023	(702)
USD	2.044.339	CNH	14.534.000	HSBC Bank	13/9/2023	45.705
USD	51.879.805	BRL	250.638.951	JP Morgan	5/9/2023	1.015.859
USD	13.310.050	MXN	227.104.100	Goldman Sachs	13/9/2023	(238.982)
USD	3.097.971	ZAR	54.563.100	Goldman Sachs	13/9/2023	196.434
USD	5.115.207	EGP	177.600.000	Goldman Sachs	31/1/2024	23.037
USD	12.227.108	MXN	206.900.000	JP Morgan	13/9/2023	(116.547)
USD	8.676.084	PLN	35.200.000	BNP Paribas	13/9/2023	134.743
USD	2.241.779	IDR	34.169.194.059	Barclays	13/9/2023	(1.532)
USD	558.695	BRL	2.739.785	Morgan Stanley	5/9/2023	2.691
USD	275.941	BRL	1.353.215	HSBC Bank	5/9/2023	1.323
USD	17.416.135	PLN	70.600.000	Citigroup	13/9/2023	284.922
USD	8.547.344	PLN	34.800.000	Deutsche Bank	13/9/2023	103.064
USD	16.653.814	EUR	15.100.000	Barclays	13/9/2023	264.001
USD	3.363.276	CZK	74.300.000	BNP Paribas	13/9/2023	13.536

Emerging Markets Local Currency Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	3.741.954	MXN	64.200.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(88.218)
USD	7.478.271	RON	33.827.200	Deutsche Bank	13/9/2023	51.327
USD	5.000.000	EGP	180.000.000	Goldman Sachs	7/2/2024	(127.620)
USD	4.513.040	COP	18.480.900.000	JP Morgan	13/9/2023	25.894
USD	8.208.850	PEN	30.574.000	Bank of America	13/9/2023	(79.268)
USD	4.137.993	CLP	3.577.234.677	BNP Paribas	13/9/2023	(44.307)
USD	1.468.487	CLP	1.264.079.142	Morgan Stanley	13/9/2023	(9.403)
USD	8.060.074	GBP	6.328.000	JP Morgan	13/9/2023	38.057
USD	801.191	CLP	694.288.181	Bank of America	13/9/2023	(10.531)
USD	7.890.175	NZD	13.294.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(16.596)
USD	7.907.685	AUD	12.332.000	HSBC Bank	13/9/2023	(83.034)
USD	1.271.185	CNH	9.261.000	Bank of America	13/9/2023	(2.335)
USD	1.226.281	PLN	5.070.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(3.963)
USD	679.208	ZAR	12.716.000	Royal Bank of Canada	13/9/2023	3.001
USD	1.464.941	MYR	6.796.000	Goldman Sachs	13/9/2023	(662)
USD	41.743.749	BRL	205.453.551	Goldman Sachs	3/10/2023	239.584
USD	32.788.826	BRL	160.668.854	Goldman Sachs	5/9/2023	183.152
ZAR	79.094.100	USD	4.191.637	Deutsche Bank	13/9/2023	14.399
ZAR	338.606.928	USD	18.510.636	Morgan Stanley	13/9/2023	(504.322)
ZAR	347.390.972	USD	18.620.037	JP Morgan	13/9/2023	(146.609)
ZAR	41.650.000	USD	2.296.409	RBS	13/9/2023	(81.561)
ZAR	288.200.000	USD	15.639.870	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(314.077)
ZAR	231.470.000	USD	12.419.913	State Street	13/9/2023	(110.888)
ZAR	53.360.000	USD	2.852.543	HSBC Bank	13/9/2023	(14.985)
Moins-value nette non réalisée						(1.272.682)
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	2.618.009	USD	1.705.001	BNY Mellon	15/9/2023	(8.492)
USD	37.516	AUD	58.249	BNY Mellon	15/9/2023	(229)
Moins-value nette non réalisée						(8.721)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	612.081	USD	455.132	BNY Mellon	15/9/2023	(2.619)
USD	12.015	CAD	16.217	BNY Mellon	15/9/2023	25
Moins-value nette non réalisée						(2.594)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	1.081.135	USD	1.237.965	BNY Mellon	15/9/2023	(12.387)
USD	30.157	CHF	26.443	BNY Mellon	15/9/2023	181
Moins-value nette non réalisée						(12.206)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	218.206.429	USD	239.400.061	BNY Mellon	15/9/2023	(2.530.572)
USD	5.617.563	EUR	5.155.383	BNY Mellon	15/9/2023	21.263
Moins-value nette non réalisée						(2.509.309)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	29.837.757	USD	37.963.060	BNY Mellon	15/9/2023	(137.328)
USD	1.480.343	GBP	1.163.902	BNY Mellon	15/9/2023	4.849
Moins-value nette non réalisée						(132.479)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	12.699.921	USD	1.627.190	BNY Mellon	15/9/2023	(7.044)
USD	44.033	HKD	344.357	BNY Mellon	15/9/2023	103
Moins-value nette non réalisée						(6.941)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	239.652	USD	144.771	BNY Mellon	15/9/2023	(2.234)
USD	3.815	NZD	6.414	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(2.234)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Local Currency Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	9.069.293	USD	2.232.767	BNY Mellon	15/9/2023	(32.352)
USD	79.220	PLN	324.717	BNY Mellon	15/9/2023	437
Moins-value nette non réalisée						(31.915)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	35.357	USD	3.309	BNY Mellon	15/9/2023	(66)
USD	75	SEK	807	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(66)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	18.171.561	USD	13.499.371	BNY Mellon	15/9/2023	(49.283)
USD	905.403	SGD	1.224.958	BNY Mellon	15/9/2023	(1.274)
Moins-value nette non réalisée						(50.557)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 3.391.087.649)						(4.029.704)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
251	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	27.833.547	212.499
97	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	10.360.054	61.383
Total				38.193.601	273.882

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	BRL 28.932.977	Fund receives Fixed 12,97%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	522.548	522.548
IRS	BRL 33.393.032	Fund receives Fixed 12,51%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	477.779	477.779
IRS	BRL 31.855.207	Fund receives Fixed 12,34%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	4/1/2027	414.861	414.861
IRS	BRL 15.697.926	Fund receives Fixed 11,3675%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2029	102.323	102.323
IRS	BRL 16.365.064	Fund receives Fixed 12,74%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2029	361.909	361.909
IRS	BRL 46.828.624	Fund receives Fixed 11,985%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	465.022	465.022
IRS	BRL 56.747.094	Fund receives Fixed 12,78%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	934.357	934.357
IRS	INR 225.829.524	Fund receives Fixed 6,085%; and pays Floating INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	20/9/2025	(28.904)	(28.904)
IRS	MXN 111.938.932	Fund receives Fixed 9,29%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Morgan Stanley	17/2/2028	68.345	68.345
IRS	THB 723.225.602	Fund receives Fixed 2,5207%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Morgan Stanley	15/3/2028	(15.334)	(15.334)
IRS	MXN 74.352.041	Fund receives Fixed 8,215%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Morgan Stanley	7/7/2028	(126.428)	(126.428)
IRS	MXN 71.667.241	Fund receives Floating MXN MXIBTIE 1 Month; and pays Fixed 9,155%	Morgan Stanley	15/8/2028	(39.660)	(39.660)
IRS	THB 329.964.491	Fund receives Fixed 2,258%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Morgan Stanley	20/9/2028	(140.457)	(140.457)
IRS	CNY 17.103.900	Fund receives Fixed 2,42%; and pays Floating CNY CNRR 3 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	12.686	12.686
IRS	CNY 17.103.901	Fund receives Fixed 2,43%; and pays Floating CNY CNRR 3 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	13.795	13.795

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Local Currency Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	THB 190.960.490	Fund receives Fixed 2,476%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Morgan Stanley	20/9/2028	(25.558)	(25.558)
IRS	CZK 168.212.878	Fund receives Fixed 4,391%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	54.174	54.174
IRS	CZK 182.245.306	Fund receives Fixed 4,434%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	74.700	74.700
IRS	CZK 128.733.964	Fund receives Fixed 4,59%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	93.786	93.786
IRS	CZK 204.236.126	Fund receives Fixed 4,77%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	223.880	223.880
IRS	CZK 111.116.341	Fund receives Fixed 4,8%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	128.613	128.613
IRS	CZK 170.010.754	Fund receives Fixed 4,88%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	224.561	224.561
IRS	CZK 195.579.664	Fund receives Fixed 4,96%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Morgan Stanley	20/9/2028	290.293	290.293
IRS	THB 172.383.988	Fund receives Fixed 2,6425%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Morgan Stanley	15/3/2033	(88.912)	(88.912)
IRS	THB 132.541.042	Fund receives Fixed 2,6925%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Morgan Stanley	15/3/2033	(52.470)	(52.470)
IRS	THB 1.095.663.955	Fund receives Fixed 2,837%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Morgan Stanley	15/3/2033	(54.079)	(54.079)
IRS	THB 183.224.826	Fund receives Fixed 2,61%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Morgan Stanley	20/9/2033	(125.089)	(125.089)
IRS	THB 343.339.319	Fund receives Fixed 2,6475%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Morgan Stanley	20/9/2033	(202.298)	(202.298)
IRS	THB 165.288.977	Fund receives Fixed 2,7%; and pays Floating THB-THOR-OIS Compound 1 Day	Morgan Stanley	20/9/2033	(75.753)	(75.753)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 220.092.158)					3.488.690	3.488.690

IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
154.000.000	Put	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1,09	29/9/2023	913.854	1.587.937
161.100.000	Call	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 5,45	31/10/2023	(404.831)	391.808
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 108.216.662)						509.023	1.979.745

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Sustainable Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Brésil							
69.719	Arezzo Industria e Comercio	1.039.099	1,34				
378.256	B3 - Brasil Bolsa Balcao	999.606	1,29				
258.141	Banco Bradesco	783.304	1,01				
1.894.554	Hapvida Participacoes e Investimentos	1.691.967	2,18				
489.573	Sendas Distribuidora	1.182.487	1,52				
		5.696.463	7,34				
Îles Caïmans							
265.200	Alibaba	3.049.995	3,94				
16.377	Alibaba	1.519.131	1,96				
51.200	Baidu	910.022	1,17				
3.215	Baidu	458.909	0,59				
313.000	China Mengniu Dairy	1.053.579	1,36				
39.996	Kanzhun	606.339	0,78				
72.797	KE	1.252.108	1,62				
79.834	Pagseguro Digital	726.490	0,94				
12.537	Tencent*	522.542	0,68				
		10.099.115	13,04				
Chine							
61.200	Asymchem Laboratories Tianjin	1.119.212	1,44				
249.500	China Merchants Bank	986.169	1,27				
136.200	China Merchants Bank	590.639	0,76				
35.840	Contemporary Ampere Technology	1.165.298	1,50				
178.600	Ganfeng Lithium	853.949	1,10				
64.000	Haier Smart Home	206.813	0,27				
277.200	Haier Smart Home	857.085	1,11				
1.654.000	Industrial & Commercial Bank of China	759.202	0,98				
178.140	LONGi Green Energy Technology	650.088	0,84				
223.100	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	910.756	1,17				
		8.099.211	10,44				
Hong Kong							
128.200	AIA	1.163.823	1,50				
788.000	Hang Lung Properties	1.052.947	1,36				
		2.216.770	2,86				
Hongrie							
32.748	OTP Bank	1.344.401	1,73				
Inde							
457.304	Aditya Birla Capital	1.000.656	1,29				
21.235	Alkem Laboratories	934.405	1,20				
5.673	Axis Bank	66.710	0,09				
20.626	Axis Bank	1.212.809	1,56				
225.789	Crompton Greaves Consumer Electricals	818.348	1,06				
53.284	HDFC Bank	1.011.438	1,31				
19.866	HDFC Bank	1.242.817	1,60				
26.602	Hindustan Unilever	804.957	1,04				
46.265	ICICI Bank*	1.077.512	1,39				
71.524	Infosys	1.240.171	1,60				
145.179	Marico	999.674	1,29				
		10.409.497	13,43				
Indonésie							
2.075.000	Bank Central Asia	1.250.041	1,61				
3.878.600	Bank Rakyat Indonesia Persero	1.413.410	1,83				
		2.663.451	3,44				
				Kazakhstan			
		14.743		Kaspi.KZ JSC		1.533.272	1,98
				Mexique			
		155.247		Grupo Financiero Banorte		1.373.387	1,77
		375.394		Wal-Mart de Mexico		1.532.711	1,98
						2.906.098	3,75
				Afrique du Sud			
		39.554		Gold Fields		511.971	0,66
		39.018		Gold Fields		502.942	0,65
		7.112		Naspers		1.219.524	1,57
		53.193		Shoprite		747.221	0,97
						2.981.658	3,85
				Corée du Sud			
		1.646		Samsung Biologics		917.800	1,19
		77.983		Samsung Electronics		3.947.087	5,09
		907		Samsung Electronics		1.147.355	1,48
		39.405		Samsung Electronics		1.609.889	2,08
		2.322		Samsung SDI		1.078.652	1,39
						8.700.783	11,23
				Taiwan			
		101.000		Accton Technology		1.515.958	1,96
		112.000		Delta Electronics		1.216.836	1,57
		141.000		Taiwan Semiconductor Manufacturing		2.430.689	3,13
		47.042		Taiwan Semiconductor Manufacturing		4.415.832	5,70
						9.579.315	12,36
				Thaïlande			
		1.342.700		Bangkok Dusit Medical Services		1.073.623	1,38
		622.800		CP ALL		1.160.496	1,50
						2.234.119	2,88
				Émirats arabes unis			
		421.227		Abu Dhabi Commercial Bank		989.691	1,28
		851.319		Aldar Properties		1.219.131	1,57
						2.208.822	2,85
				Royaume-Uni			
		58.635		Prudential		731.448	0,94
				États-Unis			
		19.330		Cognizant Technology Solutions		1.385.768	1,79
		4.516		EPAM Systems		1.164.902	1,50
						2.550.670	3,29
Total des actions ordinaires et privilégiées						73.955.093	95,41
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé						73.955.093	95,41
Autres titres négociables							
ACTIONS ORDINAIRES							
Chypre							
		5.357		TCS**		85.712	0,11
Total des actions ordinaires						85.712	0,11
Total des autres valeurs mobilières						85.712	0,11
Total du portefeuille						74.040.805	95,52
Autres éléments de l'actif net						3.475.021	4,48
Total de l'actif net (USD)						77.515.826	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Emerging Markets Sustainable Equity Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	8.344	USD	5.038	BNY Mellon	15/9/2023	(76)
USD	416	NZD	697	BNY Mellon	15/9/2023	2
Moins-value nette non réalisée						(74)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 5.377)						(74)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Moins-value non réalisée USD
23	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	1.133.095	(8.735)
Total				1.133.095	(8.735)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Moins-value non réalisée USD
Îles Caïmans			
47.077	Pagseguro Digital	JP Morgan	(51.785)
			(51.785)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 428.401)			(51.785)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Finance	28,81
Technologie	24,35
Communications	14,04
Biens de consommation non cyclique	12,05
Biens de consommation cyclique	10,28
Valeurs industrielles	2,74
Matériaux de base	2,41
Énergie	0,84
Autres éléments de l'actif net	4,48
<hr/>	
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Flex Choice Cautious Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				44.147	iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	318.344	3,24
				422.963	iShares USD Corp Bond ESG UCITS ETF ^{*,-}	1.777.460	18,08
				123.419	iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF ⁻	549.400	5,59
				903	iShares USD TIPS UCITS ETF ^{*,-}	206.236	2,10
				37.767	iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻	193.329	1,97
				6.683	iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF ⁻	852.617	8,67
				212.805	iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻	762.906	7,76
				272.926	iShares USD Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF ⁻	1.285.294	13,07
				2.944	iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻	511.019	5,20
				9.512	iShares USD Ultrashort Bond ESG UCITS ETF ⁻	48.057	0,49
COMPARTIMENTS				Total des Compartiments			
Irlande						9.827.574	99,95
118.476	iShares Asia Investment Grade Corp Bond UCITS ETF ⁻	548.177	5,57	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
105.618	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF ⁻	420.148	4,27			9.827.574	99,95
21.222	iShares Global Clean Energy UCITS ETF ⁻	197.407	2,01	Total du portefeuille			
18.502	iShares IV Public Company - iShares MSCI Japan SRI UCITS ETF USD ^{*,-}	118.783	1,21			9.827.574	99,95
132.449	iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF ⁻	540.392	5,50	Autres éléments de l'actif net			
174	iShares MSCI Canada UCITS ETF ⁻	29.824	0,30			4.973	0,05
24.465	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	117.542	1,19	Total de l'actif net (USD)			
2.849	iShares MSCI Europe SRI UCITS ETF ⁻	325.869	3,31			9.832.547	100,00
6.178	iShares MSCI Pacific EX-Japan ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	29.192	0,30				
15.839	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	128.217	1,30				
59.201	iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF ⁻	499.064	5,07				
40.158	iShares MSCI USA SRI UCITS ETF ⁻	368.297	3,75				

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

ESG Flex Choice Cautious Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	210.581	JPY	29.762.524	Deutsche Bank	5/9/2023	6.912
Plus-value nette non réalisée						6.912
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	144.272	USD	93.958	BNY Mellon	15/9/2023	(468)
USD	1.797	AUD	2.788	BNY Mellon	15/9/2023	(10)
Moins-value nette non réalisée						(478)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	18.724	USD	13.924	BNY Mellon	15/9/2023	(81)
USD	257	CAD	346	BNY Mellon	15/9/2023	1
Moins-value nette non réalisée						(80)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	5.670.096	USD	785.769	BNY Mellon	15/9/2023	(5.965)
USD	16.262	CNY	118.508	BNY Mellon	15/9/2023	(36)
Moins-value nette non réalisée						(6.001)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	11.888	USD	15.126	BNY Mellon	15/9/2023	(54)
USD	275	GBP	216	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(54)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	947.621	USD	121.417	BNY Mellon	15/9/2023	(528)
USD	2.253	HKD	17.622	BNY Mellon	15/9/2023	5
Moins-value nette non réalisée						(523)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.245.431)						(224)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Flex Choice Growth Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				209.479	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	1.695.733	13,67
				134.379	iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF ⁻	1.132.815	9,13
				249.291	iShares MSCI USA SRI UCITS ETF ⁻	2.286.298	18,43
				167.092	iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	1.204.900	9,71
				196.656	iShares USD Corp Bond ESG UCITS ETF ⁻	826.427	6,66
				20.554	iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF ⁻	91.496	0,74
				1.120	iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻	255.797	2,06
				49.442	iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻	253.094	2,04
				893	iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF ⁻	113.929	0,92
				54.982	iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻	197.110	1,59
				24.521	iShares USD Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF ⁻	115.477	0,93
COMPARTIMENTS							
Irlande							
36.743	iShares Asia Investment Grade Corp Bond UCITS ETF ⁻	170.006	1,37				
37.915	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF ⁻	239.357	1,93				
13.751	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF ⁻	54.701	0,44				
25.616	iShares Global Clean Energy UCITS ETF ⁻	238.280	1,92				
79.076	iShares IV Public Company - iShares MSCI Japan SRI UCITS ETF USD* ⁻	507.668	4,09				
47.366	iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF ⁻	193.253	1,56				
1.379	iShares MSCI Canada UCITS ETF ⁻	236.361	1,90				
200.270	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	962.197	7,76				
11.651	iShares MSCI Europe SRI UCITS ETF ⁻	1.332.641	10,74				
46.392	iShares MSCI Pacific EX-Japan ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	219.212	1,77				
19.585	iShares MSCI UK IMI ESG Leaders UCITS ETF ⁻	116.662	0,94				
				Total des Compartiments		12.443.414	100,30
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		12.443.414	100,30
				Total du portefeuille		12.443.414	100,30
				Autres éléments du passif net		(37.469)	(0,30)
				Total de l'actif net (USD)		12.405.945	100,00

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

ESG Flex Choice Growth Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	660.936	JPY	93.413.567	Deutsche Bank	5/9/2023	21.693
Plus-value nette non réalisée						21.693
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	1.310.480	USD	853.049	BNY Mellon	15/9/2023	(3.839)
USD	32.478	AUD	50.499	BNY Mellon	15/9/2023	(246)
Moins-value nette non réalisée						(4.085)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	20.347	USD	15.127	BNY Mellon	15/9/2023	(85)
USD	646	CAD	874	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(85)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	4.770.896	USD	657.832	BNY Mellon	15/9/2023	(1.697)
USD	19.660	CNY	143.427	BNY Mellon	15/9/2023	(64)
Moins-value nette non réalisée						(1.761)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	72.464	USD	92.191	BNY Mellon	15/9/2023	(327)
USD	3.927	GBP	3.093	BNY Mellon	15/9/2023	6
Moins-value nette non réalisée						(321)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	22.529.189	USD	2.886.407	BNY Mellon	15/9/2023	(12.329)
USD	351.130	HKD	2.743.794	BNY Mellon	15/9/2023	1.102
Moins-value nette non réalisée						(11.227)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 5.528.640)						4.214

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Flex Choice Moderate Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				76.043	iShares MSCI USA ESG Screened UCITS ETF ⁻	641.042	4,84
				178.777	iShares MSCI USA SRI UCITS ETF ⁻	1.639.600	12,37
				144.065	iShares MSCI World ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	1.038.853	7,84
				428.012	iShares USD Corp Bond ESG UCITS ETF ⁻	1.798.678	13,57
				56.736	iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF ⁻	252.560	1,91
				1.146	iShares USD TIPS UCITS ETF ⁻	261.735	1,97
				51.261	iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF ⁻	262.405	1,98
				1.744	iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF ⁻	222.500	1,68
				119.161	iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF ⁻	427.192	3,22
				159.309	iShares USD Treasury Bond 3-7yr UCITS ETF ⁻	750.236	5,66
				1.220	iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF ⁻	211.768	1,60
				13.092	iShares USD Ultrashort Bond ESG UCITS ETF ⁻	66.143	0,50
COMPARTIMENTS							
Irlande							
68.724	iShares Asia Investment Grade Corp Bond UCITS ETF ⁻	317.979	2,40				
21.123	iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCITS ETF ⁻	133.349	1,01				
46.037	iShares Global Aggregate Bond ESG UCITS ETF ⁻	183.135	1,38				
28.032	iShares Global Clean Energy UCITS ETF ⁻	260.754	1,97				
66.847	iShares IV Public Company - iShares MSCI Japan SRI UCITS ETF USD ⁻	429.158	3,24				
77.569	iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF ⁻	316.481	2,39				
949	iShares MSCI Canada UCITS ETF ⁻	162.659	1,23				
152.559	iShares MSCI EM ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	732.970	5,53				
9.714	iShares MSCI Europe SRI UCITS ETF ⁻	1.111.087	8,38				
34.476	iShares MSCI Pacific EX-Japan ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	162.906	1,23				
13.535	iShares MSCI UK IMI ESG Leaders UCITS ETF ⁻	80.624	0,61				
222.391	iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF ⁻	1.800.255	13,58				
Total des Compartiments						13.264.069	100,09
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé						13.264.069	100,09
Total du portefeuille						13.264.069	100,09
Autres éléments du passif net						(12.112)	(0,09)
Total de l'actif net (USD)						13.251.957	100,00

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

ESG Flex Choice Moderate Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	459.631	JPY	64.961.976	Deutsche Bank	5/9/2023	15.086
USD	75.100	JPY	10.713.220	JP Morgan	5/9/2023	1.788
Plus-value nette non réalisée						16.874
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	239.593	USD	156.024	BNY Mellon	15/9/2023	(764)
USD	5.614	AUD	8.724	BNY Mellon	15/9/2023	(40)
Moins-value nette non réalisée						(804)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	19.775	USD	14.703	BNY Mellon	15/9/2023	(84)
USD	529	CAD	716	BNY Mellon	15/9/2023	1
Moins-value nette non réalisée						(83)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	4.944.366	USD	682.704	BNY Mellon	15/9/2023	(2.711)
USD	17.092	CNY	124.609	BNY Mellon	15/9/2023	(46)
Moins-value nette non réalisée						(2.757)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	227.575	USD	289.530	BNY Mellon	15/9/2023	(1.027)
USD	10.404	GBP	8.193	BNY Mellon	15/9/2023	16
Moins-value nette non réalisée						(1.011)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	17.639.730	USD	2.259.942	BNY Mellon	15/9/2023	(9.618)
USD	81.386	HKD	636.921	BNY Mellon	15/9/2023	133
Moins-value nette non réalisée						(9.485)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 4.018.254)						2.734

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Guernesey				Italie			
750.000	Bluefield Solar Income Fund	998.719	0,27	21.656	UniCredit	492.782	0,13
394.929	Syncona	612.786	0,17	Jersey			
		1.611.505	0,44	11.959	Experian	388.866	0,10
Irlande				Luxembourg			
3.505.266	iShares EUR Corp Bond ESG Paris-Aligned Climate UCITS ETF-	16.792.327	4,57	25.120	ADLER	12.836	0,00
30.638	iShares Green Bond Index Fund IE-	271.300	0,07	Pays-Bas			
		17.063.627	4,64	1.407	ASML	863.757	0,23
Jersey				10.141	ASR Nederland	413.246	0,11
1.200.000	Foresight Solar Fund	1.301.130	0,36	2.168	IMCD	277.396	0,08
Royaume-Uni				10.416	STMicroelectronics	457.627	0,12
645.343	Aquila European Renewables Income Fund	535.635	0,15	Espagne			
1.692.922	Greencoat UK Wind Fund	2.804.818	0,76	6.905	Amadeus IT	439.296	0,12
479.433	Gresham House Energy Storage Fund	744.865	0,20	6.355	Industria de Diseno Textil	225.920	0,06
		4.085.318	1,11				
Total des Compartiments				Suède			
		24.061.580	6,55	7.701	Alfa Laval	251.150	0,07
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES				18.111	Epiroc	322.254	0,09
Belgique				57.502	Tele2	376.709	0,10
9.456	Azelis	191.389	0,05	19.991	Volvo	374.960	0,10
Danemark				Suisse			
5.635	Novo Nordisk	966.256	0,27	1.190	Lonza	610.502	0,17
38.043	Tryg	670.564	0,18	8.053	Nestle	897.044	0,24
		1.636.820	0,45	2.137	Roche	584.633	0,16
Finlande				1.500	Sika	392.910	0,11
16.951	Sampo	691.601	0,19	936	Zurich Insurance	406.934	0,11
13.488	UPM-Kymmene	428.649	0,12	Royaume-Uni			
		1.120.250	0,31	6.423	AstraZeneca	807.048	0,22
France				49.954	Phoenix	302.571	0,08
9.193	ALD	82.553	0,02	13.337	RELX	402.352	0,11
6.865	BNP Paribas	412.243	0,12	1.166.666	Sdcl Energy Efficiency Income Trust	1.010.081	0,28
2.089	Capgemini	363.382	0,10	États-Unis			
9.933	Cie de Saint-Gobain	596.278	0,16	30.000	Allstate	556.895	0,15
253	Hermes International	485.102	0,13	Total des actions ordinaires et privilégiées			
992	L'Oreal	407.117	0,11			22.946.032	6,25
8.037	Sanofi	799.762	0,22	OBLIGATIONS			
2.505	Schneider Electric	399.498	0,11	Australie			
7.427	Vinci	769.734	0,21	USD 225.000	Westpac Banking 2,668% 15/11/2035*	159.473	0,04
		4.315.669	1,18	USD 95.000	Westpac Banking 4,11% 24/7/2034	76.625	0,02
Allemagne				USD 70.000	Westpac Banking 4,421% 24/7/2039	52.143	0,02
1.247	Merck	208.124	0,06				
3.214	SAP*	417.756	0,11	Autriche			
5.754	Siemens	801.762	0,22	EUR 200.000	ams-OSRAM 0% 5/3/2025	167.947	0,05
		1.427.642	0,39	Belgique			
Irlande				EUR 200.000	KBC 4,75% 5/3/2024	197.550	0,05
7.348	CRH	391.207	0,11	Îles Vierges britanniques			
2.568.350	Greencoat Renewables	2.558.077	0,70	EUR 213.000	Global Switch 2,25% 31/5/2027	198.275	0,05
1.220	Linde	437.209	0,12	Canada			
		3.386.493	0,93	USD 73.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,875% 15/1/2028	61.287	0,02

* Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 155.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	121.681	0,03	USD 102.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	98.785	0,03
USD 128.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4,375% 15/1/2028	108.415	0,03	USD 134.000	Seagate HDD Cayman 8,5% 15/7/2031	129.475	0,03
USD 36.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 5,75% 15/4/2025	32.976	0,01			248.737	0,06
USD 325.000	Bank of Nova Scotia/The 1,3% 11/6/2025	277.563	0,07		Chypre		
USD 187.000	Bank of Nova Scotia/The 3,4% 11/2/2024	170.476	0,05	EUR 375.000	Bank of Cyprus 2,5% 24/6/2027	334.575	0,09
USD 62.000	Bombardier 6% 15/2/2028	53.420	0,01		Finlande		
USD 293.000	Bombardier 7,125% 15/6/2026	265.754	0,07	EUR 600.000	Citycon 3,625% 10/6/2026*	332.280	0,09
USD 110.000	Bombardier 7,5% 1/2/2029	99.631	0,03	EUR 650.000	Finnair 4,25% 19/5/2025	617.087	0,17
USD 261.000	Bombardier 7,875% 15/4/2027	240.225	0,06	USD 240.000	Nordea Bank 3,75% 1/3/2029	166.872	0,04
USD 115.000	Canadian National Railway 4,45% 20/1/2049	93.504	0,03	USD 500.000	Nordea Bank 6,625% 26/3/2026	437.803	0,12
USD 177.000	Canadian Pacific Railway 4,8% 1/8/2045	146.088	0,04	EUR 210.000	SBB Treasury 0,75% 14/12/2028	117.821	0,03
USD 19.000	Garda World Security 4,625% 15/2/2027	16.216	0,01	EUR 310.000	SBB Treasury 1,125% 26/11/2029	172.097	0,05
USD 76.000	Garda World Security 7,75% 15/2/2028	69.945	0,02			1.843.960	0,50
USD 10.000	Garda World Security 9,5% 1/11/2027	8.919	0,00		France		
USD 58.000	GFL Environmental 3,5% 1/9/2028	47.328	0,01	EUR 600.000	Accor 4,375% 31/1/2024	593.595	0,16
USD 7.000	GFL Environmental 3,75% 1/8/2025	6.154	0,00	EUR 100.000	Air France-KLM 1,875% 16/1/2025*	95.182	0,03
USD 70.000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	57.900	0,02	EUR 200.000	Air France-KLM 8,125% 31/5/2028	208.597	0,06
USD 3.000	GFL Environmental 4,25% 1/6/2025	2.678	0,00	EUR 151.000	Altice France 2,125% 15/2/2025	140.053	0,04
USD 74.000	GFL Environmental 4,375% 15/8/2029	60.685	0,02	EUR 251.000	Altice France 2,5% 15/1/2025	232.772	0,06
USD 74.000	GFL Environmental 4,75% 15/6/2029	62.549	0,02	EUR 163.000	Altice France 3,375% 15/1/2028	114.283	0,03
USD 102.000	GFL Environmental 5,125% 15/12/2026	91.070	0,02	USD 209.000	Altice France 5,125% 15/7/2029	137.023	0,04
USD 127.000	Jones Deslauriers Insurance Management 8,5% 15/3/2030	119.601	0,03	EUR 400.000	Atos 0% 6/11/2024	337.270	0,09
USD 66.000	Jones Deslauriers Insurance Management 10,5% 15/12/2030	61.988	0,02	EUR 100.000	Atos 1,75% 7/5/2025	82.425	0,02
USD 257.000	Nutrien 4,9% 27/3/2028	231.390	0,06	EUR 200.000	Atos 2,5% 7/11/2028	142.501	0,04
USD 65.000	Nutrien 5,8% 27/3/2053	58.552	0,02	EUR 200.000	Banijay 6,5% 1/3/2026	198.006	0,05
USD 75.000	Nutrien 5,9% 7/11/2024	69.105	0,02	USD 400.000	BNP Paribas 2,819% 19/11/2025	353.793	0,10
USD 244.000	Open Text 6,9% 1/12/2027	228.304	0,06	USD 1.100.000	BNP Paribas 4,625% 25/2/2031	740.292	0,20
USD 103.000	Rogers Communications 4,3% 15/2/2048	71.268	0,02	USD 200.000	BNP Paribas 5,285% 28/3/2024	171.253	0,05
USD 121.000	Rogers Communications 4,35% 1/5/2049	84.521	0,02	EUR 200.000	BNP Paribas 6,875% 6/12/2029	193.255	0,05
USD 756.000	Rogers Communications 4,55% 15/3/2052	539.728	0,15	EUR 200.000	BNP Paribas 7,375% 11/6/2030	197.500	0,05
USD 140.000	Toronto-Dominion Bank/The 0,7% 10/9/2024	122.741	0,03	USD 200.000	BNP Paribas 8,5% 14/8/2028*	184.396	0,05
USD 250.000	Toronto-Dominion Bank/The 1,25% 10/9/2026	204.184	0,06	EUR 100.000	Burger King France 8,475% 1/11/2026	100.560	0,03
USD 150.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,65% 12/6/2024	134.958	0,04	GBP 700.000	Clariane 4,125% 15/3/2024*	632.671	0,17
USD 285.000	Toronto-Dominion Bank/The 5,532% 17/7/2026	263.085	0,07	USD 536.000	Constellium 3,75% 15/4/2029	424.657	0,12
USD 253.000	TransAlta 7,75% 15/11/2029	240.240	0,06	USD 760.000	Credit Agricole 4,75% 23/3/2029	549.765	0,15
		4.524.129	1,23	USD 250.000	Credit Agricole 8,125% 23/12/2025	230.282	0,06
	Îles Caïmans			EUR 221.000	Crown European 3,375% 15/5/2025	217.060	0,06
USD 11.000	GGAM Finance 7,75% 15/5/2026	10.191	0,00	EUR 128.000	Crown European 5% 15/5/2028	128.850	0,04
USD 11.000	GGAM Finance 8% 15/6/2028	10.286	0,00	EUR 242.000	Elior 3,75% 15/7/2026	192.816	0,05
				EUR 300.000	Eutelsat 1,5% 13/10/2028*	229.210	0,06
				EUR 100.000	Eutelsat 2% 2/10/2025	91.824	0,02
				EUR 377.000	Forvia 2,75% 15/2/2027	344.201	0,09
				EUR 306.000	Forvia 7,25% 15/6/2026	318.552	0,09
				EUR 506.000	Goldstory 5,375% 1/3/2026*	489.186	0,13
				USD 200.000	Iliad 6,5% 15/10/2026	175.801	0,05
				USD 200.000	Iliad 7% 15/10/2028	171.743	0,05

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 163.000	Loxam 6,375% 15/5/2028	161.873	0,05	EUR 359.000	AIB 6,25% 23/6/2025	342.127	0,09
EUR 214.000	Paprec 3,5% 1/7/2028*	196.035	0,05	USD 365.000	Bank of Ireland 6,253% 16/9/2026	335.887	0,09
EUR 159.000	Paprec 4% 31/3/2025	156.793	0,04	EUR 353.000	Bank of Ireland 7,5% 19/5/2025	346.657	0,09
EUR 1.400.000	RCI Banque 2,625% 18/2/2030	1.317.750	0,36	GBP 239.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4,875% 15/7/2028	229.628	0,06
USD 450.000	Societe Generale 5,375% 18/11/2030*	313.649	0,09			3.163.531	0,87
USD 500.000	Societe Generale 7,875% 18/12/2023	459.649	0,12		Italie		
USD 500.000	Societe Generale 7,875% 18/12/2023*	459.649	0,13	EUR 686.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	668.504	0,18
EUR 200.000	Societe Generale 7,875% 18/1/2029	195.498	0,05	EUR 100.000	Azzurra Aeroporti 2,625% 30/5/2027	90.392	0,03
USD 600.000	Societe Generale 8% 29/9/2025*	543.938	0,15	EUR 274.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6,75% 2/3/2026	275.307	0,08
EUR 180.000	Tereos Finance Groupe I 7,25% 15/4/2028	186.867	0,05	EUR 756.000	Banco BPM 2,875% 29/6/2031*	676.620	0,18
EUR 314.000	Vallourec 8,5% 30/6/2026	313.965	0,09	EUR 200.000	Banco BPM 3,375% 19/1/2032	177.750	0,05
		12.725.040	3,47	EUR 375.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	377.443	0,10
				EUR 248.000	Castor 8,776% 15/2/2029	234.566	0,06
				EUR 200.000	Cedacri Mergesco 8,424% 15/5/2028	195.563	0,05
	Allemagne			EUR 178.000	Cedacri Mergesco 9,281% 15/5/2028	175.341	0,05
USD 200.000	Allianz 3,2% 30/10/2027	140.232	0,04	EUR 175.000	Enel 6,375% 16/4/2028	178.894	0,05
USD 400.000	Allianz 3,5% 17/11/2025	309.687	0,08	EUR 270.000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11,125% 15/5/2028	269.927	0,07
EUR 800.000	Bayer 4,5% 25/3/2082*	760.791	0,21	EUR 342.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5,625% 1/8/2027	320.312	0,09
EUR 800.000	Commerzbank 6,125% 9/10/2025	726.600	0,20	EUR 154.000	IMA Industria Macchine Automatiche 3,75% 15/1/2028	137.872	0,04
USD 430.000	Deutsche Bank 1,447% 1/4/2025	383.904	0,10	EUR 116.000	IMA Industria Macchine Automatiche 7,663% 15/1/2028*	115.737	0,03
USD 305.000	Deutsche Bank 2,129% 24/11/2026	254.925	0,07	EUR 486.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,625% 21/10/2028	428.633	0,12
USD 990.000	Deutsche Bank 2,222% 18/9/2024	911.032	0,25	EUR 364.000	Inter Media and Communication 6,75% 9/2/2027	352.099	0,10
USD 800.000	Deutsche Bank 6% 30/10/2025*	596.497	0,16	EUR 1.030.000	Intesa Sanpaolo 5,5% 1/3/2028*	894.812	0,24
USD 250.000	Deutsche Bank 6,119% 14/7/2026	228.957	0,06	EUR 700.000	Nexi 0% 24/2/2028	547.669	0,15
USD 210.000	Deutsche Bank 7,079% 10/2/2034	184.421	0,05	EUR 1.100.000	Poste Italiane 2,625% 24/3/2029*	860.750	0,23
EUR 200.000	Deutsche Bank 10% 1/12/2027	200.404	0,06	EUR 492.000	Rekeep 7,25% 1/2/2026*	457.912	0,13
EUR 500.000	Deutsche Lufthansa 3,5% 14/7/2029	454.677	0,12	EUR 100.000	Telecom Italia 1,625% 18/1/2029	78.817	0,02
EUR 400.000	DIC Asset 2,25% 22/9/2026	219.500	0,06	EUR 465.000	Telecom Italia 2,375% 12/10/2027	405.699	0,11
EUR 207.000	Gruenthal 4,125% 15/5/2028	193.728	0,05	EUR 380.000	Telecom Italia 2,875% 28/1/2026	361.749	0,10
EUR 600.000	Tele Columbus 3,875% 2/5/2025*	384.990	0,10	EUR 313.000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	302.586	0,08
EUR 180.000	TK Elevator Holdco 6,625% 15/7/2028*	155.765	0,04	EUR 541.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	547.078	0,15
EUR 430.000	TK Elevator Midco 4,375% 15/7/2027*	392.650	0,11	EUR 265.000	UniCredit 4,875% 20/2/2029*	264.338	0,07
EUR 180.000	TUI Cruises 6,5% 15/5/2026*	170.842	0,05	EUR 1.200.000	UniCredit 7,5% 3/6/2026*	1.203.000	0,33
		6.669.602	1,81	USD 800.000	UniCredit 8% 3/6/2024	727.226	0,20
						11.326.596	3,09
	Irlande				Japon		
USD 251.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 3,5% 15/1/2025	223.549	0,06	USD 300.000	Mitsubishi UFJ Financial 0,953% 19/7/2025	264.188	0,07
USD 150.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 3,65% 21/7/2027	127.399	0,04	USD 400.000	Mitsubishi UFJ Financial 2,527% 13/9/2023	368.424	0,10
USD 195.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 4,625% 15/10/2027	170.607	0,05	USD 210.000	Mitsubishi UFJ Financial 2,559% 25/2/2030	162.914	0,04
USD 192.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 5,75% 6/6/2028	175.284	0,05	USD 200.000	Mitsubishi UFJ Financial 3,195% 18/7/2029	162.781	0,04
USD 150.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 6,5% 15/7/2025	138.950	0,04	USD 200.000	Mitsubishi UFJ Financial 5,541% 17/4/2026	183.393	0,05
USD 975.000	AIB 4,263% 10/4/2025	885.343	0,25				
EUR 200.000	AIB 5,25% 9/10/2024	188.100	0,05				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 275.000	Mizuho Financial 0,849% 8/9/2024	253.382	0,07				
EUR 298.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	288.248	0,08				
EUR 664.000	SoftBank 3,125% 19/9/2025*	631.212	0,17				
EUR 389.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032*	304.761	0,08				
EUR 100.000	SoftBank 4% 19/9/2029	86.131	0,02				
EUR 129.000	SoftBank 4,5% 20/4/2025	126.676	0,03				
EUR 100.000	SoftBank 4,75% 30/7/2025	98.099	0,03				
EUR 100.000	SoftBank 5% 15/4/2028	94.389	0,03				
USD 335.000	Sumitomo Mitsui Financial 1,474% 8/7/2025	285.800	0,08				
USD 550.000	Sumitomo Mitsui Financial 2,632% 14/7/2026	467.722	0,13				
USD 250.000	Sumitomo Mitsui Financial 3,944% 19/7/2028	215.109	0,06				
USD 215.000	Takeda Pharmaceutical 3,175% 9/7/2050	133.202	0,04				
		4.126.431	1,12				
	Jersey						
EUR 61.276	Adient Global 3,5% 15/8/2024	60.333	0,02				
USD 230.000	Aptiv 5,4% 15/3/2049	186.760	0,05				
USD 98.000	Aptiv / Aptiv 3,25% 1/3/2032	76.615	0,02				
USD 167.000	Aptiv / Aptiv 4,15% 1/5/2052	114.449	0,03				
GBP 100.000	CPUK Finance 4,5% 28/8/2027	102.102	0,03				
GBP 200.000	CPUK Finance 4,875% 28/8/2025	223.529	0,06				
		763.788	0,21				
	Luxembourg						
EUR 389.000	Adler Financing 12,5% 30/6/2025	401.709	0,11				
GBP 260.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,875% 1/6/2028*	241.613	0,07				
EUR 250.000	Altice Financing 2,25% 15/1/2025	239.375	0,06				
EUR 1.200.000	Aroundtown 3,375% 23/9/2024	502.860	0,14				
USD 93.000	Camelot Finance 4,5% 1/11/2026	80.328	0,02				
GBP 366.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	377.898	0,10				
USD 200.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	174.979	0,05				
EUR 538.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	551.762	0,15				
EUR 400.000	European TopSoho 4% 21/9/2021***	308.000	0,08				
EUR 175.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	135.600	0,03				
USD 200.000	Herens Holdco 4,75% 15/5/2028	141.790	0,04				
USD 226.000	Medtronic Global 4,25% 30/3/2028	202.247	0,06				
USD 304.000	Medtronic Global 4,5% 30/3/2033	271.163	0,07				
EUR 144.000	Monitchem HoldCo 3 8,75% 1/5/2028	142.772	0,04				
EUR 400.000	Rossini 6,75% 30/10/2025*	403.500	0,11				
EUR 520.000	SES 2,875% 27/5/2026*	453.518	0,12				
EUR 200.000	SES 5,625% 29/1/2024	200.140	0,05				
EUR 306.000	Summer BC Holdco B 5,75% 31/10/2026	278.185	0,08				
USD 133.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	101.825	0,03				
USD 172.000	Telecom Italia Capital 6,375% 15/11/2033	138.704	0,04				
USD 200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5,5% 1/3/2028	169.409	0,05				
		5.517.377	1,50				
					Îles Marshall		
				USD 200.000	Danaos 8,5% 1/3/2028	186.717	0,05
					Pays-Bas		
				EUR 700.000	Abertis Infraestructuras Finance 3,248% 24/11/2025*	635.635	0,17
				EUR 100.000	Axalta Coating Systems Dutch B 3,75% 15/1/2025	99.047	0,03
				USD 251.000	Elastic 4,125% 15/7/2029	199.219	0,05
				USD 1.280.000	Enel Finance International 1,375% 12/7/2026	1.045.641	0,28
				USD 200.000	ING Groep 1,4% 1/7/2026	169.401	0,05
				USD 935.000	ING Groep 3,875% 16/5/2027	642.166	0,17
				USD 200.000	ING Groep 4,1% 2/10/2023	184.083	0,05
				USD 200.000	ING Groep 4,625% 6/1/2026	179.918	0,05
				USD 223.000	ING Groep 5,75% 16/11/2026	182.958	0,05
				USD 375.000	JDE Peet's 1,375% 15/1/2027	300.050	0,08
				USD 10.000	NXP / NXP Funding 5,55% 1/12/2028	9.234	0,00
				USD 375.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2,5% 11/5/2031	279.038	0,08
				USD 566.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4,3% 18/6/2029	488.577	0,13
				EUR 257.000	OI European 6,25% 15/5/2028*	263.429	0,07
				USD 60.000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	48.695	0,01
				USD 375.000	Siemens Financieringsmaatschappij 2,875% 11/3/2041	254.351	0,07
				EUR 521.926	Summer BidCo 9% 15/11/2025	490.203	0,13
				EUR 400.000	Telefonica Europe 3,875% 22/6/2026*	374.080	0,10
				EUR 1.100.000	Telefonica Europe 6,135% 3/2/2030	1.076.559	0,29
				EUR 200.000	Telefonica Europe 7,125% 23/8/2028*	205.880	0,06
				EUR 687.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,375% 15/9/2029	705.223	0,19
				EUR 171.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,875% 15/9/2031	179.388	0,05
				USD 200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3,15% 1/10/2026	166.952	0,05
				USD 200.000	Trivium Packaging Finance 5,5% 15/8/2026	174.225	0,05
				EUR 193.000	Trivium Packaging Finance 7,531% 15/8/2026	190.165	0,05
				USD 200.000	Trivium Packaging Finance 8,5% 15/8/2027	175.036	0,05
				EUR 164.000	UPC 3,875% 15/6/2029	136.640	0,04
				EUR 425.000	VZ Secured Financing 3,5% 15/1/2032	335.376	0,09
				EUR 600.000	VZ Vendor Financing II 2,875% 15/1/2029	467.961	0,13
				EUR 400.000	Ziggo 2,875% 15/1/2030*	331.496	0,09
				USD 200.000	Ziggo Bond 5,125% 28/2/2030	143.068	0,04
						10.133.694	2,75
					Portugal		
				EUR 200.000	EDP - Energias de Portugal 1,7% 20/7/2080	184.850	0,05
				EUR 400.000	EDP - Energias de Portugal 1,875% 2/8/2081	358.000	0,10
				EUR 100.000	EDP - Energias de Portugal 5,943% 23/4/2083	99.200	0,03
						642.050	0,18
					Roumanie		
				EUR 300.000	RCS & RDS 2,5% 5/2/2025	287.839	0,08

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Singapour				USD 230.000	Barclays 3,932% 7/5/2025	208.909	0,06
USD 290.000	Pfizer Investment Enterprises 4,65% 19/5/2030	263.313	0,07	USD 225.000	Barclays 5,088% 20/6/2030	190.058	0,05
USD 477.000	Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	433.075	0,12	USD 510.000	Barclays 5,2% 12/5/2026	456.315	0,12
USD 370.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	341.738	0,09	USD 360.000	Barclays 5,829% 9/5/2027	328.750	0,09
		1.038.126	0,28	USD 450.000	Barclays 6,125% 15/12/2025	368.576	0,10
Espagne				GBP 400.000	Barclays 6,375% 15/12/2025	415.366	0,11
EUR 1.400.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 15/1/2026	1.332.366	0,36	GBP 200.000	Barclays 7,125% 15/6/2025	215.788	0,06
USD 800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6,125% 16/11/2027*	632.250	0,17	USD 695.000	Barclays 8% 15/3/2029*	571.921	0,16
EUR 200.000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	186.445	0,05	GBP 100.000	BCP V Modular Services Finance II 6,125% 30/11/2028*	95.871	0,03
EUR 1.000.000	Banco de Sabadell 2,5% 15/4/2031	893.855	0,24	GBP 1.055.000	Bellis Acquisition 4,5% 16/2/2026	1.082.573	0,29
EUR 200.000	Banco de Sabadell 5,75% 15/3/2026	174.357	0,05	EUR 100.000	British Telecommunications 1,874% 18/8/2080	91.480	0,03
EUR 200.000	Banco de Sabadell 6% 16/8/2033	189.100	0,05	USD 200.000	British Telecommunications 4,25% 23/11/2081*	162.771	0,05
EUR 200.000	Bankinter 7,375% 15/8/2028	191.215	0,05	USD 600.000	British Telecommunications 4,875% 23/11/2081	454.043	0,12
EUR 800.000	CaixaBank 6,375% 19/9/2023*	802.000	0,22	GBP 100.000	British Telecommunications 8,375% 20/12/2083	117.023	0,03
EUR 200.000	CaixaBank 6,75% 13/6/2024	197.167	0,06	GBP 275.000	BUPA Finance 4% 24/9/2031*	193.686	0,05
EUR 200.000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	174.186	0,05	GBP 212.000	Constellation Automotive Financing 4,875% 15/7/2027	198.635	0,05
EUR 400.000	Cellnex Finance 1,5% 8/6/2028*	347.430	0,09	GBP 196.000	Gatwick Airport Finance 4,375% 7/4/2026	210.110	0,06
EUR 100.000	Cellnex Finance 2% 15/9/2032	79.110	0,02	GBP 930.000	Heathrow Finance 4,125% 1/9/2029	879.889	0,24
EUR 500.000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	393.754	0,11	GBP 220.000	Heathrow Finance 4,75% 1/3/2024	252.581	0,07
EUR 600.000	Cellnex Telecom 0,75% 20/11/2031	461.502	0,13	USD 725.000	HSBC 2,633% 7/11/2025	640.866	0,17
EUR 100.000	Cellnex Telecom 1% 20/4/2027	88.979	0,02	USD 200.000	HSBC 4,25% 14/3/2024	182.399	0,05
EUR 400.000	Cellnex Telecom 1,75% 23/10/2030*	328.452	0,09	USD 275.000	HSBC 4,375% 23/11/2026	241.365	0,07
EUR 100.000	Cellnex Telecom 2,125% 11/8/2030	97.235	0,03	USD 200.000	HSBC 4,583% 19/6/2029	173.709	0,05
EUR 237.000	Food Service Project 5,5% 21/1/2027	226.196	0,06	USD 310.000	HSBC 4,6% 17/12/2030	221.713	0,06
EUR 144.000	Grifols 3,2% 1/5/2025	139.175	0,04	USD 250.000	HSBC 6% 22/5/2027	206.811	0,06
EUR 164.000	Grifols 3,875% 15/10/2028	142.718	0,04	USD 365.000	HSBC 6,254% 9/3/2034	340.491	0,09
EUR 200.000	International Consolidated Airlines 3,75% 25/3/2029*	174.991	0,05	USD 200.000	HSBC 6,375% 30/3/2025	177.940	0,05
EUR 340.000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	316.377	0,08	USD 255.000	HSBC 7,39% 3/11/2028	246.803	0,07
		7.568.860	2,06	USD 200.000	HSBC 8% 7/3/2028	184.352	0,05
Suède				USD 335.000	HSBC 8,113% 3/11/2033	335.921	0,09
EUR 130.000	Dometic 3% 8/5/2026	122.470	0,03	USD 855.000	Lloyds Banking 4,582% 10/12/2025	758.594	0,21
EUR 1.800.000	Heimstaden Bostad 2,625% 1/2/2027	781.470	0,21	EUR 969.000	Lloyds Banking 4,947% 27/6/2025*	908.176	0,25
EUR 325.000	Intrum 4,875% 15/8/2025*	281.926	0,08	USD 325.000	Lloyds Banking 6,75% 27/6/2026	276.007	0,07
EUR 346.000	Verisure 9,25% 15/10/2027	369.454	0,10	USD 200.000	Lloyds Banking 7,5% 27/9/2025	173.082	0,05
		1.555.320	0,42	USD 200.000	Lloyds Banking 8% 27/9/2029	167.316	0,05
Suisse				USD 200.000	Merlin Entertainments 5,75% 15/6/2026	177.804	0,05
USD 250.000	Credit Suisse 7,5% 15/2/2028	245.889	0,07	GBP 800.000	Mobico 4,25% 26/11/2025	815.870	0,22
GBP 100.000	Credit Suisse 7,75% 10/3/2026	120.745	0,03	GBP 200.000	Nationwide Building Society 5,75% 20/6/2027*	201.148	0,05
USD 200.000	UBS 4,375% 10/2/2031	136.505	0,04	USD 735.000	NTT Finance 1,162% 3/4/2026	610.522	0,17
USD 210.000	UBS 4,875% 12/2/2027	161.611	0,04	GBP 120.000	Pinewood Finance 3,625% 15/11/2027*	121.884	0,03
USD 300.000	UBS 5,959% 12/1/2034*	277.796	0,08	GBP 1.137.000	Premier Foods Finance 3,5% 15/10/2026*	1.201.967	0,33
USD 250.000	UBS 7% 31/1/2024*	228.786	0,06	USD 188.000	Rio Tinto Finance USA 5% 9/3/2033	172.252	0,05
USD 907.000	UBS 7% 19/2/2025*	816.074	0,22	USD 634.000	Santander UK 5% 7/11/2023	582.251	0,16
EUR 316.000	UBS 7,75% 1/3/2029	357.307	0,10	GBP 200.000	Santander UK 6,75% 24/6/2024	226.486	0,06
USD 615.000	UBS 9,016% 15/11/2033	687.405	0,19	USD 400.000	Standard Chartered 4,3% 19/8/2028	272.210	0,07
		3.032.118	0,83	EUR 299.000	Synthomer 3,875% 1/7/2025*	276.881	0,07
Royaume-Uni				GBP 223.000	Thames Water Kemble Finance 4,625% 19/5/2026	176.525	0,05
EUR 1.200.000	Agps Bondco 5,5% 13/11/2026	403.500	0,11	EUR 150.000	Thames Water Utilities Finance 4% 18/4/2027	143.625	0,04
EUR 300.000	Agps Bondco 6% 5/8/2025	116.685	0,03				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 200.000	Vmed O2 UK Financing I 4,25% 31/1/2031	150.916	0,04	USD 33.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4,25% 15/10/2027	27.703	0,01
USD 200.000	Vmed O2 UK Financing I 4,75% 15/7/2031	153.577	0,04	USD 195.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 5,875% 1/11/2029	157.385	0,04
EUR 500.000	Vodafone 2,625% 27/8/2080	456.950	0,13	USD 154.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/10/2027	134.207	0,04
EUR 100.000	Vodafone 3% 27/8/2080	82.170	0,02	USD 53.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/4/2028	48.191	0,01
USD 245.000	Vodafone 3,25% 4/6/2081	199.113	0,05	USD 214.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6,625% 15/7/2026	187.992	0,05
EUR 400.000	Vodafone 4,2% 3/10/2078	370.500	0,10	USD 104.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 9,75% 15/7/2027	88.083	0,02
GBP 322.000	Vodafone 4,875% 3/10/2078	354.611	0,10	USD 500.000	Allstate 8,564% 15/8/2053	454.516	0,12
USD 750.000	Vodafone 5,125% 4/6/2081	485.975	0,13	USD 1.050.000	Ally Finacial 4,7% 15/5/2026	681.658	0,19
USD 75.000	Vodafone 6,15% 27/2/2037	70.815	0,02	USD 575.000	Ally Finacial 5,75% 20/11/2025*	514.102	0,14
		19.554.127	5,33	USD 84.000	Alphabet 2,05% 15/8/2050	46.530	0,01
	États-Unis			USD 102.000	Alteryx 8,75% 15/3/2028*	90.958	0,02
USD 258.000	Abbott Laboratories 4,75% 30/11/2036	236.050	0,06	USD 190.000	Amazon.com 2,5% 3/6/2050	111.982	0,03
USD 498.000	AbbVie 2,6% 21/11/2024	442.606	0,12	USD 155.000	Amazon.com 2,7% 3/6/2060	88.849	0,02
USD 35.000	AbbVie 3,2% 14/5/2026	30.639	0,01	USD 59.000	Amazon.com 3,1% 12/5/2051	38.960	0,01
USD 391.000	AbbVie 4,4% 6/11/2042	314.356	0,09	USD 275.000	Amazon.com 3,15% 22/8/2027	238.199	0,06
USD 98.000	AbbVie 4,45% 14/5/2046	78.152	0,02	USD 365.000	Amazon.com 3,875% 22/8/2037	302.185	0,08
USD 43.000	AbbVie 4,55% 15/3/2035	37.504	0,01	USD 130.000	Amazon.com 4,1% 13/4/2062	99.498	0,03
USD 515.000	AbbVie 4,875% 14/11/2048	438.989	0,12	USD 32.000	AMC Networks 4,25% 15/2/2029	18.859	0,00
USD 29.000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	24.689	0,01	USD 16.000	American Airlines 7,25% 15/2/2028	14.510	0,00
USD 48.000	Acadia Healthcare 5,5% 1/7/2028	41.852	0,01	USD 69.716	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,5% 20/4/2026	63.192	0,01
USD 109.000	AdaptHealth 6,125% 1/8/2028	90.769	0,02	USD 201.140	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,75% 20/4/2029	178.166	0,05
USD 8.000	ADT Security 4,125% 1/8/2029	6.447	0,00	USD 930.000	American Express 3,55% 15/9/2026	713.802	0,19
USD 69.000	ADT Security 4,875% 15/7/2032	54.952	0,01	USD 700.000	American Express 3,95% 1/8/2025	625.910	0,17
USD 67.000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	58.956	0,02	USD 380.000	American Honda Finance 2% 24/3/2028	306.501	0,08
USD 191.000	Advanced Drainage Systems 6,375% 15/6/2030	174.178	0,05	USD 110.000	American Tower 1,3% 15/9/2025	92.963	0,03
USD 396.000	AES 1,375% 15/1/2026	328.277	0,09	USD 255.000	American Tower 1,6% 15/4/2026	212.223	0,06
USD 384.000	AES 2,45% 15/1/2031	281.256	0,08	USD 120.000	American Tower 1,875% 15/10/2030	86.148	0,02
USD 158.000	Aetna 3,875% 15/8/2047	109.410	0,03	USD 550.000	American Tower 2,1% 15/6/2030	404.719	0,11
USD 75.000	Aetna 4,125% 15/11/2042	55.129	0,01	USD 174.000	American Tower 3,375% 15/10/2026	150.167	0,04
USD 172.000	AHP Health Partners 5,75% 15/7/2029	135.484	0,04	USD 95.000	American Tower 3,55% 15/7/2027	81.194	0,02
USD 240.000	Air Lease 1,875% 15/8/2026	197.872	0,05	USD 250.000	American Tower 3,95% 15/3/2029	211.664	0,06
USD 540.000	Air Lease 5,85% 15/12/2027	497.072	0,14	USD 10.000	American Tower 4% 1/6/2025	8.940	0,00
USD 50.000	Air Products and Chemicals 1,5% 15/10/2025	42.747	0,01	USD 100.000	American Tower 4,4% 15/2/2026	89.695	0,02
USD 151.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,25% 15/3/2026	129.543	0,04	USD 40.000	American Tower 5,65% 15/3/2033	36.727	0,01
USD 109.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,625% 15/1/2027	95.123	0,03	USD 45.000	Amgen 2% 15/1/2032	32.557	0,01
USD 49.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,875% 15/2/2030	41.493	0,01	USD 32.000	Amgen 2,77% 1/9/2053	17.676	0,00
USD 39.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5,875% 15/2/2028	34.909	0,01	USD 260.000	Amgen 3% 15/1/2052	156.427	0,04
USD 52.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6,5% 15/2/2028	47.738	0,01	USD 90.000	Amgen 4,2% 22/2/2052	66.217	0,02
USD 100.000	Alexander Funding Trust II 7,467% 31/7/2028	93.182	0,03	USD 225.000	Amgen 4,563% 15/6/2048	176.545	0,05
USD 320.000	Alexandria Real Estate Equities 1,875% 1/2/2033	217.755	0,06	USD 40.000	Amgen 4,875% 1/3/2053	32.800	0,01
USD 175.000	Alexandria Real Estate Equities 2,75% 15/12/2029	136.844	0,04	USD 215.000	Amgen 5,15% 2/3/2028	197.822	0,05
USD 100.000	Alexandria Real Estate Equities 3,55% 15/3/2052	63.067	0,02	USD 311.000	Amgen 5,25% 2/3/2033	285.274	0,08
USD 233.000	Alexandria Real Estate Equities 4,9% 15/12/2030	207.775	0,06	USD 195.000	Amgen 5,65% 2/3/2053	178.689	0,05
				USD 60.000	Amgen 5,75% 2/3/2063	54.661	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 142.000	AMN Healthcare 4% 15/4/2029	112.029	0,03	USD 180.000	Ball 4,875% 15/3/2026	161.228	0,04
USD 60.000	AMN Healthcare 4,625% 1/10/2027	50.687	0,01	USD 66.000	Ball 6% 15/6/2029	59.923	0,02
USD 42.000	AmWINS 4,875% 30/6/2029	34.759	0,01	EUR 117.000	Banff Merger Sub 8,375% 1/9/2026	114.344	0,03
USD 25.000	Analog Devices 1,7% 1/10/2028	19.748	0,01	USD 410.000	Bank of America 2,087% 14/6/2029	322.185	0,09
USD 67.000	Analog Devices 2,8% 1/10/2041	43.959	0,01	USD 615.000	Bank of America 2,299% 21/7/2032	447.427	0,12
USD 75.000	Analog Devices 3,5% 5/12/2026	66.121	0,02	USD 40.000	Bank of America 2,687% 22/4/2032	30.178	0,01
USD 76.000	ANGI 3,875% 15/8/2028	56.063	0,02	USD 10.000	Bank of America 2,884% 22/10/2030	7.905	0,00
USD 114.400	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	95.847	0,03	USD 1.081.000	Bank of America 2,972% 4/2/2033	819.581	0,22
USD 25.000	API DE 4,125% 15/7/2029	19.935	0,01	USD 25.000	Bank of America 3,194% 23/7/2030	20.200	0,01
USD 29.000	API DE 4,75% 15/10/2029	24.193	0,01	USD 1.270.000	Bank of America 3,419% 20/12/2028	1.072.543	0,29
USD 175.000	Apple 2,2% 11/9/2029	140.955	0,04	USD 73.000	Bank of America 3,593% 21/7/2028	62.553	0,02
USD 180.000	Apple 2,65% 8/2/2051	110.388	0,03	USD 290.000	Bank of America 3,705% 24/4/2028	250.083	0,07
USD 615.000	Apple 2,7% 5/8/2051	378.031	0,10	USD 875.000	Bank of America 3,824% 20/1/2028	759.760	0,21
USD 15.000	Apple 2,9% 12/9/2027	12.931	0,00	USD 425.000	Bank of America 3,974% 7/2/2030	361.136	0,10
USD 70.000	Apple 3,45% 9/2/2045	52.370	0,01	USD 175.000	Bank of America 4,443% 20/1/2048	137.636	0,04
USD 230.000	Apple 3,95% 8/8/2052	179.890	0,05	USD 108.000	Bank of America 4,75% 21/4/2045	89.634	0,02
USD 324.000	Applied Materials 3,3% 1/4/2027	283.028	0,08	USD 761.000	Bank of New York Mellon 3,7% 20/3/2026	630.528	0,17
USD 89.000	APX 5,75% 15/7/2029	70.821	0,02	USD 25.000	Baxalta 5,25% 23/6/2045	21.597	0,01
USD 111.000	APX 6,75% 15/2/2027	99.107	0,03	USD 195.000	Baxter International 2,539% 1/2/2032	144.418	0,04
USD 10.000	Aramark Services 5% 1/4/2025	9.112	0,00	USD 424.000	Bayer US Finance II 4,375% 15/12/2028	371.061	0,10
USD 207.000	Aramark Services 5% 1/2/2028	178.220	0,05	USD 53.000	Beacon Roofing Supply 4,125% 15/5/2029	42.117	0,01
USD 169.000	Aramark Services 6,375% 1/5/2025	156.340	0,05	USD 57.000	Beacon Roofing Supply 6,5% 1/8/2030	51.811	0,01
USD 256.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	191.826	0,05	USD 133.000	Becton Dickinson 3,7% 6/6/2027	115.985	0,03
USD 200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	180.725	0,05	USD 408.000	Becton Dickinson 3,734% 15/12/2024	366.941	0,10
USD 59.000	Asbury Automotive 4,5% 1/3/2028	49.647	0,01	USD 73.000	Becton Dickinson 4,685% 15/12/2044	59.659	0,02
USD 49.000	Asbury Automotive 5% 15/2/2032	38.713	0,01	USD 641.000	Berry Global 1,57% 15/1/2026	537.544	0,15
USD 167.000	Ashland 3,375% 1/9/2031	123.388	0,03	USD 165.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	151.419	0,04
USD 96.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	76.304	0,02	USD 188.000	Black Knight InfoServ 3,625% 1/9/2028	160.718	0,04
USD 350.000	AT&T 3,5% 1/6/2041	236.870	0,06	USD 72.000	Block 2,75% 1/6/2026	60.299	0,02
USD 450.000	AT&T 3,65% 1/6/2051	284.828	0,08	USD 462.000	Block 3,5% 1/6/2031	350.165	0,10
USD 610.000	AT&T 4,5% 15/5/2035	499.528	0,14	USD 75.000	Boise Cascade 4,875% 1/7/2030	62.413	0,02
USD 150.000	AthenaHealth 6,5% 15/2/2030	119.896	0,04	EUR 289.000	Boxer Parent 6,5% 2/10/2025	287.150	0,08
USD 330.000	Autodesk 2,4% 15/12/2031	246.979	0,07	USD 80.000	Boxer Parent 9,125% 1/3/2026	73.865	0,02
USD 85.000	Autodesk 3,5% 15/6/2027	73.949	0,02	USD 19.000	Boyne USA 4,75% 15/5/2029	15.804	0,00
USD 92.000	AvalonBay Communities 5% 15/2/2033	84.063	0,02	USD 105.000	Bristol-Myers Squibb 3,2% 15/6/2026	92.286	0,03
EUR 145.000	Avantor Funding 2,625% 1/11/2025	138.131	0,04	USD 107.000	Bristol-Myers Squibb 3,4% 26/7/2029	91.261	0,02
USD 160.000	Avantor Funding 3,875% 1/11/2029	129.349	0,04	USD 131.000	Broadcom 3,419% 15/4/2033	100.187	0,03
USD 237.000	Avantor Funding 4,625% 15/7/2028	202.908	0,06	USD 129.000	Broadcom 4,15% 15/4/2032	106.528	0,03
USD 510.000	Aviation Capital 1,95% 20/9/2026	413.524	0,11	USD 819.000	Broadcom 4,926% 15/5/2037	679.130	0,18
USD 49.000	Avient 7,125% 1/8/2030	45.264	0,01	USD 35.000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGSI Sellco LL 4,5% 1/4/2027	26.975	0,01
USD 364.000	Axalta Coating Systems 3,375% 15/2/2029	284.842	0,08				
USD 275.000	Axalta Coating Systems / Axalta Coating Systems Dutch B 4,75% 15/6/2027	238.628	0,06				
USD 207.000	Ball 3,125% 15/9/2031	154.867	0,04				

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 26.000	Cable One 0% 15/3/2026	19.817	0,01	USD 110.000	Charles Schwab 6,136% 24/8/2034	103.300	0,03
USD 156.000	Cable One 1,125% 15/3/2028	109.028	0,03	USD 31.000	Chemours 4,625% 15/11/2029	23.777	0,01
USD 78.000	Cable One 4% 15/11/2030	56.137	0,02	USD 7.000	Chemours 5,75% 15/11/2028	5.782	0,00
USD 240.000	Cablevision Lightpath 5,625% 15/9/2028	170.247	0,05	USD 57.000	Chobani / Chobani Finance 4,625% 15/11/2028	47.189	0,01
USD 115.000	Camden Property Trust 2,8% 15/5/2030	92.143	0,03	USD 101.000	Chobani / Chobani Finance 7,5% 15/4/2025	92.958	0,03
USD 94.000	Camelot Return Merger Sub 8,75% 1/8/2028	85.897	0,02	USD 80.000	CHS/Community Health Systems 4,75% 15/2/2031	55.479	0,01
USD 550.000	Capital One Financial 2,618% 2/11/2032	386.590	0,11	USD 102.000	CHS/Community Health Systems 5,25% 15/5/2030	74.172	0,02
USD 95.000	Capital One Financial 5,817% 1/2/2034	83.255	0,02	USD 20.000	CHS/Community Health Systems 5,625% 15/3/2027	16.301	0,00
USD 155.000	Capital One Financial 6,377% 8/6/2034	141.459	0,04	USD 234.000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	180.875	0,05
USD 75.000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	68.144	0,02	USD 130.000	Citigroup 1,122% 28/1/2027	107.316	0,03
USD 16.000	Carrier Global 2,242% 15/2/2025	14.027	0,00	USD 515.000	Citigroup 2,976% 5/11/2030	407.760	0,11
EUR 355.000	Catalent Pharma Solutions 2,375% 1/3/2028	297.332	0,08	USD 50.000	Citigroup 3,52% 27/10/2028	42.508	0,01
USD 176.000	Catalent Pharma Solutions 3,125% 15/2/2029	136.411	0,04	USD 131.000	Citigroup 3,668% 24/7/2028	112.199	0,03
USD 8.000	Catalent Pharma Solutions 3,5% 1/4/2030	6.206	0,00	USD 850.000	Citigroup 3,887% 10/1/2028	739.876	0,20
USD 6.000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	5.169	0,00	USD 225.000	Citigroup 6,174% 25/5/2034	207.191	0,06
USD 189.000	CCO / CCO Capital 4,25% 1/2/2031	143.432	0,04	USD 121.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,75% 15/5/2028	111.353	0,03
USD 36.000	CCO / CCO Capital 4,25% 15/1/2034	25.445	0,01	USD 195.000	Clarios Global / Clarios US Finance 8,5% 15/5/2027	181.877	0,05
USD 86.000	CCO / CCO Capital 4,5% 15/8/2030	66.824	0,02	USD 496.000	Clarivate Science 3,875% 1/7/2028	403.165	0,11
USD 39.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/3/2030	31.029	0,01	USD 241.000	Clarivate Science 4,875% 1/7/2029	194.052	0,05
USD 51.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/2/2032	39.026	0,01	USD 279.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	230.878	0,06
USD 88.000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	74.818	0,02	USD 188.000	Clear Channel Outdoor 7,5% 1/6/2029	129.298	0,03
USD 30.000	CCO / CCO Capital 5,125% 1/5/2027	26.085	0,01	USD 4.000	Clear Channel Outdoor 7,75% 15/4/2028	2.890	0,00
USD 56.000	CCO / CCO Capital 6,375% 1/9/2029	48.981	0,01	USD 190.000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	175.982	0,05
USD 230.000	CCO / CCO Capital 7,375% 1/3/2031	210.918	0,06	USD 3.000	Clearway Energy Operating 3,75% 15/2/2031	2.264	0,00
USD 95.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,5% 1/5/2025	86.986	0,02	USD 175.000	Clearway Energy Operating 3,75% 15/1/2032	131.777	0,04
USD 107.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 6,5% 1/10/2028	95.488	0,03	USD 800.000	Clearway Energy Operating 4,75% 15/3/2028	683.978	0,19
USD 22.000	Centene 2,5% 1/3/2031	16.141	0,00	USD 470.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	387.483	0,11
USD 49.000	Centene 3% 15/10/2030	37.529	0,01	USD 327.000	Cloud Software 9% 30/9/2029	269.556	0,07
USD 305.000	Centene 3,375% 15/2/2030	240.726	0,07	USD 46.000	Clydesdale Acquisition 6,625% 15/4/2029	40.404	0,01
USD 242.000	Centene 4,625% 15/12/2029	205.131	0,06	USD 66.000	Clydesdale Acquisition 8,75% 15/4/2030	55.040	0,02
USD 212.000	CenterPoint Energy Houston Electric 4,95% 1/4/2033	192.273	0,05	USD 150.000	Comcast 2,8% 15/1/2051	87.856	0,02
USD 198.000	Central Parent / CDK Global 7,25% 15/6/2029	180.356	0,05	USD 75.000	Comcast 2,887% 1/11/2051	44.388	0,01
USD 101.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	94.349	0,03	USD 162.000	Comcast 2,937% 1/11/2056	93.066	0,03
USD 52.000	Charles River Laboratories International 4,25% 1/5/2028	43.988	0,01	USD 310.000	Comcast 3,45% 1/2/2050	208.758	0,06
USD 281.000	Charles Schwab 4% 1/6/2026	223.736	0,06	USD 30.000	Comcast 3,75% 1/4/2040	22.768	0,01
USD 604.000	Charles Schwab 4% 1/12/2030	418.228	0,11	USD 305.000	Comcast 3,9% 1/3/2038	239.632	0,07
USD 200.000	Charles Schwab 5,875% 24/8/2026	185.397	0,05	USD 200.000	Comcast 4% 15/8/2047	148.327	0,04
				USD 475.000	Comcast 4,4% 15/8/2035	406.017	0,11
				USD 125.000	Comcast 4,7% 15/10/2048	104.376	0,03
				USD 515.000	Commonwealth Edison 3,85% 15/3/2052	362.431	0,10
				USD 105.000	CommScope 6% 1/3/2026	87.762	0,02
				USD 53.000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	44.702	0,01
				USD 70.000	Compass Diversified 5,25% 15/4/2029	59.302	0,02
				USD 97.000	Consensus Cloud Solutions 6% 15/10/2026	83.333	0,02
				USD 22.000	Consensus Cloud Solutions 6,5% 15/10/2028	18.251	0,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net			Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 122.000	CoreLogic 4,5% 1/5/2028	92.028	0,02	USD 145.000	Encompass Health 4,5% 1/2/2028	124.502	0,03
USD 80.000	Coty/HFC Prestige Products/ HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030	73.530	0,02	USD 46.000	Encompass Health 4,625% 1/4/2031	37.168	0,01
USD 45.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	35.710	0,01	USD 14.000	Encompass Health 4,75% 1/2/2030	11.782	0,00
USD 91.000	Covanta 5% 1/9/2030	71.278	0,02	EUR 148.000	Encore Capital 4,875% 15/10/2025*	141.546	0,04
USD 62.000	Crocs 4,125% 15/8/2031	45.339	0,01	GBP 400.000	Encore Capital 5,375% 15/2/2026*	421.423	0,11
USD 6.000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	4.744	0,00	USD 23.000	Entegris 4,375% 15/4/2028	19.443	0,01
USD 183.000	Crown Americas / Crown Americas Capital V 4,25% 30/9/2026	159.144	0,04	USD 420.000	Entegris Escrow 4,75% 15/4/2029	359.784	0,10
USD 475.000	Crown Castle 2,5% 15/7/2031	353.440	0,10	USD 125.000	Equinix 1,55% 15/3/2028	97.253	0,03
USD 100.000	Crown Castle 2,9% 1/4/2041	62.241	0,02	USD 105.000	Equinix 2,5% 15/5/2031	78.322	0,02
USD 75.000	Crown Castle 3,1% 15/11/2029	60.145	0,02	USD 205.000	Equinix 2,9% 18/11/2026	174.546	0,05
USD 50.000	Crown Castle 3,8% 15/2/2028	42.857	0,01	USD 20.000	Equinix 3% 15/7/2050	11.674	0,00
USD 230.000	Crown Castle 4,3% 15/2/2029	199.100	0,05	USD 90.000	Equinix 3,2% 18/11/2029	72.597	0,02
USD 26.000	Crown Castle 5,1% 1/5/2033	23.062	0,01	USD 50.000	Equinix 3,4% 15/2/2052	31.329	0,01
USD 222.000	CSC 4,125% 1/12/2030	146.096	0,04	USD 199.000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	167.855	0,05
USD 200.000	CSC 4,5% 15/11/2031	131.402	0,04	USD 592.873	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2052	531.131	0,14
USD 50.000	CSX 2,5% 15/5/2051	28.068	0,01	USD 300.000	FedEx 3,1% 5/8/2029	247.555	0,07
USD 80.000	CSX 3,35% 15/9/2049	52.473	0,02	USD 60.000	FedEx 4,55% 1/4/2046	46.428	0,01
USD 77.000	CSX 4,25% 15/3/2029	68.421	0,02	USD 50.000	FedEx 5,25% 15/5/2050	42.932	0,01
USD 50.000	CSX 4,3% 1/3/2048	38.893	0,01	USD 49.000	Fidelity National Information Services 1,15% 1/3/2026	40.639	0,01
USD 25.000	CSX 4,75% 15/11/2048	20.621	0,01	USD 118.000	Fidelity National Information Services 4,7% 15/7/2027	106.513	0,03
USD 223.000	Cushman & Wakefield US Borrower 6,75% 15/5/2028	194.535	0,05	USD 100.000	Fifth Third Bancorp 6,339% 27/7/2029	93.227	0,03
USD 36.000	Cushman & Wakefield US Borrower 8,875% 1/9/2031	33.551	0,01	USD 510.000	FirstEnergy Transmission 4,35% 15/1/2025	457.637	0,12
USD 170.000	CVS Health 1,3% 21/8/2027	134.794	0,04	USD 285.000	Fiserv 2,75% 1/7/2024	256.084	0,07
USD 316.000	CVS Health 5% 20/2/2026	288.876	0,08	USD 69.000	Fiserv 4,4% 1/7/2049	52.092	0,01
USD 234.000	CVS Health 5,05% 25/3/2048	189.392	0,05	USD 243.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032	175.174	0,05
USD 100.000	CVS Health 5,125% 20/7/2045	82.123	0,02	USD 136.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	119.642	0,03
USD 115.000	Darling Ingredients 5,25% 15/4/2027	103.209	0,03	GBP 142.000	Ford Motor Credit 2,748% 14/6/2024	159.836	0,04
USD 287.000	Darling Ingredients 6% 15/6/2030	259.156	0,07	USD 200.000	Ford Motor Credit 4,389% 8/1/2026	174.748	0,05
USD 275.000	Dell International / EMC 6,02% 15/6/2026	256.066	0,07	GBP 520.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	581.066	0,16
USD 107.000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5,875% 15/8/2027	87.614	0,02	USD 200.000	Ford Motor Credit 5,125% 16/6/2025	179.560	0,05
USD 28.000	Dream Finders Homes 8,25% 15/8/2028	26.190	0,01	EUR 150.000	Ford Motor Credit 6,125% 15/5/2028	154.030	0,04
USD 307.000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029	252.910	0,07	USD 208.000	Ford Motor Credit 6,8% 12/5/2028	191.758	0,05
USD 145.000	DuPont de Nemours 5,319% 15/11/2038	130.804	0,04	GBP 368.000	Ford Motor Credit 6,86% 5/6/2026*	419.697	0,11
USD 28.000	DuPont de Nemours 5,419% 15/11/2048	25.033	0,01	USD 200.000	Ford Motor Credit 7,35% 6/3/2030	187.840	0,05
USD 94.000	Dycom Industries 4,5% 15/4/2029	77.501	0,02	USD 47.000	Fortrea 7,5% 1/7/2030	42.800	0,01
USD 315.000	Ecolab 2,7% 15/12/2051	184.196	0,05	USD 63.000	Foundation Building Materials 6% 1/3/2029	49.155	0,01
USD 447.000	Element Solutions 3,875% 1/9/2028	362.321	0,10	USD 3.000.000	Freddie Mac Pool 5,5% 1/8/2053	2.733.850	0,74
USD 500.000	Elevance Health 3,65% 1/12/2027	434.450	0,12	USD 112.000	Freeport-McMoRan 5,4% 14/11/2034	97.874	0,03
USD 113.000	Elevance Health 3,7% 15/9/2049	77.822	0,02	USD 98.000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	77.427	0,02
USD 195.000	Elevance Health 4,75% 15/2/2033	174.156	0,05	USD 135.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	113.389	0,03
USD 160.000	Elevance Health 5,5% 15/10/2032	150.425	0,04	USD 209.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	187.011	0,05
USD 25.000	Elevance Health 6,1% 15/10/2052	24.532	0,01	USD 130.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	127.787	0,03
USD 40.000	Embeckta 6,75% 15/2/2030	32.533	0,01	USD 118.000	Gartner 4,5% 1/7/2028	101.572	0,03
EUR 187.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	187.042	0,05	USD 365.000	GATX 4,35% 15/2/2024	334.736	0,09
USD 429.000	Emerald Debt Merger Sub 6,625% 15/12/2030	389.110	0,11	USD 32.000	GCI 4,75% 15/10/2028	25.620	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 104.000	Gen Digital 6,75% 30/9/2027	95.908	0,03	USD 91.456	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2051	74.196	0,02
USD 54.000	General Electric 8,882% 15/9/2023	49.885	0,01	USD 316.419	Ginnie Mae II Pool 3% 20/2/2052	256.992	0,07
USD 15.000	General Mills 2,25% 14/10/2031	11.179	0,00	USD 404.157	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	329.023	0,09
USD 64.000	General Mills 3% 1/2/2051	39.788	0,01	USD 530.416	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	431.510	0,12
USD 50.000	General Mills 4% 17/4/2025	44.903	0,01	USD 547.793	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	445.385	0,12
USD 252.000	General Mills 4,95% 29/3/2033	226.486	0,06	USD 617.540	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	505.067	0,14
USD 244.000	General Motors 5,4% 1/4/2048	188.023	0,06	USD 313.218	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2042	265.603	0,07
USD 350.000	General Motors 5,6% 15/10/2032	310.402	0,08	USD 543.092	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2042	460.533	0,13
USD 575.000	General Motors Financial 2,9% 26/2/2025	506.049	0,14	USD 925.393	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2043	784.717	0,21
USD 332.000	General Motors Financial 5% 9/4/2027	298.064	0,08	USD 1.319.682	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2044	1.119.068	0,30
USD 190.000	Gilead Sciences 2,8% 1/10/2050	113.158	0,03	USD 620.029	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	522.259	0,14
USD 45.000	Gilead Sciences 4,15% 1/3/2047	34.758	0,01	USD 234.603	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/4/2048	197.229	0,05
USD 130.000	Gilead Sciences 4,5% 1/2/2045	105.404	0,03	USD 2.042.456	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2048	1.717.028	0,47
USD 315.000	Gilead Sciences 4,75% 1/3/2046	264.486	0,07	USD 796.202	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	677.467	0,18
USD 1.245.296	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/1/2050	958.134	0,26	USD 2.090.027	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	1.718.080	0,47
USD 1.062.796	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/3/2050	817.611	0,22	USD 1.258.191	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	1.065.591	0,29
USD 1.268.273	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/8/2050	997.058	0,27	USD 1.242.017	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	1.051.437	0,29
USD 1.977.604	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/10/2050	1.554.710	0,42	USD 1.245.170	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	1.050.279	0,29
USD 753.126	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/10/2050	592.069	0,16	USD 1.447.491	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	1.220.423	0,33
USD 1.231.856	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/11/2050	968.365	0,26	USD 1.967.559	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	1.684.760	0,46
USD 9.652.011	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/2/2051	7.752.756	2,11	USD 696.795	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2051	587.506	0,16
USD 860.421	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/2/2051	680.317	0,19	USD 310.092	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/8/2051	261.581	0,07
USD 2.029.420	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/2/2051	1.589.974	0,43	USD 68.940	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	57.676	0,02
USD 1.133.106	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/5/2051	887.212	0,24	USD 57.298	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	48.263	0,01
USD 1.789.506	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/5/2051	1.401.195	0,38	USD 39.622	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	33.374	0,01
USD 1.544.809	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/5/2051	1.210.001	0,33	USD 192.999	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	162.746	0,04
USD 7.123.814	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/5/2051	5.455.109	1,49	USD 197.676	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	166.671	0,05
USD 4.613.570	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2050	3.761.732	1,02	USD 246.022	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	207.431	0,06
USD 1.019.222	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	829.727	0,23	USD 532.582	Ginnie Mae II Pool 4% 20/12/2041	460.978	0,13
USD 1.263.982	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	1.028.257	0,28	USD 530.556	Ginnie Mae II Pool 4% 20/7/2044	461.780	0,13
USD 3.055.873	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	2.514.100	0,68	USD 507.892	Ginnie Mae II Pool 4% 20/8/2044	438.597	0,12
USD 1.965.553	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2051	1.599.634	0,44	USD 1.389.742	Ginnie Mae II Pool 4% 20/9/2047	1.178.258	0,32
USD 5.387.352	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2051	4.388.707	1,19	USD 157.611	Ginnie Mae II Pool 4% 20/11/2047	135.661	0,04
USD 3.920.559	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2051	3.194.356	0,87	USD 456.713	Ginnie Mae II Pool 4% 20/4/2049	393.119	0,11
USD 3.948.075	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2051	3.272.513	0,89	USD 305.950	Ginnie Mae II Pool 4% 20/10/2049	262.132	0,07
USD 1.386.348	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2051	1.128.722	0,31				
USD 3.376.590	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2051	2.750.807	0,75				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 539.866	Ginnie Mae II Pool 4% 20/10/2049	462.414	0,13	USD 95.000	Healthpeak 5,25% 15/12/2032	84.558	0,02
USD 323.914	Ginnie Mae II Pool 4% 20/11/2049	277.364	0,08	USD 192.000	Herc 5,5% 15/7/2027	170.453	0,05
USD 160.705	Ginnie Mae II Pool 4% 20/3/2050	138.334	0,04	USD 48.000	Hertz 4,625% 1/12/2026	39.940	0,01
USD 131.347	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2050	113.069	0,03	USD 21.000	Hertz 5% 1/12/2029	15.926	0,00
USD 468.250	Ginnie Mae II Pool 4% 20/7/2051	403.960	0,11	USD 23.000	Hilton Domestic Operating 3,625% 15/2/2032	17.632	0,01
USD 1.082.982	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/5/2050	955.199	0,26	USD 158.000	Hilton Domestic Operating 3,75% 1/5/2029	128.540	0,04
USD 120.000	Global Payments 4,45% 1/6/2028	104.247	0,03	USD 146.000	Hilton Domestic Operating 4,875% 15/1/2030	125.618	0,03
USD 190.000	Global Payments 5,4% 15/8/2032	171.454	0,05	USD 91.000	Hilton Domestic Operating 5,75% 1/5/2028	82.365	0,02
USD 145.000	Global Payments 5,95% 15/8/2052	127.779	0,03	USD 175.000	Hologic 3,25% 15/2/2029	140.533	0,04
USD 151.000	Go Daddy Operating / GD Finance 3,5% 1/3/2029	119.895	0,03	USD 236.000	Home Depot 3,35% 15/4/2050	159.624	0,04
USD 43.000	Go Daddy Operating / GD Finance 5,25% 1/12/2027	37.887	0,01	USD 65.000	Home Depot 3,9% 15/6/2047	48.859	0,01
USD 40.000	Goldman Sachs 1,093% 9/12/2026	33.074	0,01	USD 60.000	Home Depot 4,2% 1/4/2043	48.234	0,01
USD 305.000	Goldman Sachs 1,992% 27/1/2032	219.111	0,06	USD 50.000	Home Depot 4,25% 1/4/2046	39.578	0,01
USD 125.000	Goldman Sachs 2,383% 21/7/2032	91.087	0,02	USD 105.000	Home Depot 4,5% 6/12/2048	86.660	0,02
USD 563.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	420.304	0,11	USD 174.000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	150.369	0,04
USD 190.000	Goldman Sachs 2,65% 21/10/2032	140.615	0,04	USD 74.000	Howard Hughes 4,125% 1/2/2029	56.166	0,01
USD 260.000	Goldman Sachs 3,691% 5/6/2028	224.275	0,06	USD 106.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	88.231	0,02
USD 190.000	Goldman Sachs 3,75% 25/2/2026	167.929	0,05	USD 630.000	HP 2,2% 17/6/2025	546.964	0,15
USD 40.000	Goldman Sachs 3,814% 23/4/2029	34.113	0,01	USD 350.000	HP 3% 17/6/2027	296.586	0,08
USD 500.000	Goldman Sachs 5,7% 1/11/2024	460.032	0,13	USD 143.000	HUB International 7% 1/5/2026	131.715	0,04
USD 9.000	Goodyear Tire & Rubber 5,625% 30/4/2033	7.128	0,00	USD 365.000	HUB International 7,25% 15/6/2030	340.981	0,09
USD 177.000	Goodyear Tire & Rubber 9,5% 31/5/2025	166.804	0,05	USD 13.000	Hughes Satellite Systems 5,25% 1/8/2026	10.940	0,00
USD 6.504.728	Government National Mortgage Association 2,5% 20/10/2051	825.136	0,22	USD 45.000	Intel 2,8% 12/8/2041	28.843	0,01
USD 137.000	Graphic Packaging International 3,5% 15/3/2028	112.674	0,03	USD 10.000	Intel 3,2% 12/8/2061	5.787	0,00
USD 24.000	Gray Television 5,875% 15/7/2026	20.264	0,01	USD 25.000	Intel 5,05% 5/8/2062	20.552	0,01
USD 15.000	Gray Television 7% 15/5/2027	12.427	0,00	USD 125.000	Intel 5,625% 10/2/2043	114.748	0,03
USD 27.000	GTCR AP Finance 8% 15/5/2027	24.646	0,01	USD 325.000	Intel 5,7% 10/2/2053	297.314	0,08
USD 197.000	GYP III 4,625% 1/5/2029	159.896	0,04	USD 85.000	Intel 5,9% 10/2/2063	78.741	0,02
USD 9.000	Hanesbrands 4,875% 15/5/2026	7.769	0,00	USD 130.000	Intercontinental Exchange 3,75% 1/12/2025	115.633	0,03
USD 166.000	Hanesbrands 9% 15/2/2031*	153.685	0,04	USD 260.000	Intercontinental Exchange 3,75% 21/9/2028	226.023	0,06
USD 170.000	HAT I / HAT II 3,375% 15/6/2026	140.735	0,04	USD 25.000	Intercontinental Exchange 4,25% 21/9/2048	19.388	0,01
USD 85.000	HB Fuller 4% 15/2/2027	73.035	0,02	USD 135.000	Intercontinental Exchange 4,6% 15/3/2033	119.105	0,03
USD 39.000	HB Fuller 4,25% 15/10/2028	32.120	0,01	USD 40.000	International Business Machines 4% 20/6/2042	30.387	0,01
USD 90.000	HCA 3,5% 15/7/2051	55.368	0,01	USD 124.000	Interpublic of 3,375% 1/3/2041	80.653	0,02
USD 175.000	HCA 3,625% 15/3/2032	138.724	0,04	USD 290.000	Invitation Homes Operating Partnership 5,5% 15/8/2033	258.951	0,07
USD 125.000	HCA 4,625% 15/3/2052	92.588	0,03	USD 209.000	IQVIA 5% 15/5/2027	185.219	0,05
USD 346.000	HCA 5,25% 15/6/2049	279.329	0,08	USD 26.000	Iron Mountain 5,625% 15/7/2032	21.532	0,01
USD 195.000	HCA 5,375% 1/9/2026	178.286	0,05	USD 256.000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	235.804	0,06
USD 68.000	HCA 5,5% 15/6/2047	57.104	0,02	USD 83.000	Iron Mountain Information Management Services 5% 15/7/2032	66.184	0,02
USD 293.000	HealthEquity 4,5% 1/10/2029	239.681	0,07	USD 10.000	Johnson & Johnson 3,55% 1/3/2036	8.126	0,00
USD 165.000	Healthpeak 1,35% 1/2/2027	133.307	0,04	USD 522.000	JPMorgan Chase 1,47% 22/9/2027	425.181	0,12
USD 91.000	Healthpeak 3% 15/1/2030	72.634	0,02	USD 290.000	JPMorgan Chase 2,301% 15/10/2025	256.684	0,07
				USD 310.000	JPMorgan Chase 2,525% 19/11/2041	192.088	0,05
				USD 300.000	JPMorgan Chase 2,956% 13/5/2031	235.038	0,06
				USD 155.000	JPMorgan Chase 2,963% 25/1/2033	118.812	0,03
				USD 300.000	JPMorgan Chase 3,109% 22/4/2041	204.523	0,06

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net			Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 160.000	JPMorgan Chase 3,157% 22/4/2042	108.641	0,03	USD 69.000	LifePoint Health 9,875% 15/8/2030	62.777	0,02
USD 1.830.000	JPMorgan Chase 3,22% 1/3/2025	1.663.351	0,45	USD 96.000	Lindblad Expeditions 6,75% 15/2/2027	85.795	0,02
USD 71.000	JPMorgan Chase 3,882% 24/7/2038	55.179	0,02	USD 59.000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	55.928	0,02
USD 275.000	JPMorgan Chase 4,005% 23/4/2029	237.577	0,06	USD 83.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	46.303	0,01
USD 185.000	JPMorgan Chase 4,125% 15/12/2026	164.022	0,04	USD 105.000	Lithia Motors 3,875% 1/6/2029	83.196	0,02
USD 50.000	JPMorgan Chase 4,85% 1/2/2044	43.446	0,01	USD 90.000	Live Nation Entertainment 3,75% 15/1/2028	74.066	0,02
USD 245.000	JPMorgan Chase 4,95% 1/6/2045	207.717	0,06	USD 118.000	Live Nation Entertainment 4,75% 15/10/2027	101.021	0,03
USD 765.000	JPMorgan Chase 5,299% 24/7/2029	700.959	0,19	USD 4.000	Live Nation Entertainment 5,625% 15/3/2026	3.579	0,00
USD 15.000	JPMorgan Chase 5,625% 16/8/2043	13.777	0,00	USD 155.000	Live Nation Entertainment 6,5% 15/5/2027	143.064	0,04
USD 29.000	KB Home 7,25% 15/7/2030	26.958	0,01	USD 75.000	Lowe's 2,8% 15/9/2041	47.572	0,01
USD 102.000	Keurig Dr Pepper 4,5% 15/4/2052	79.991	0,02	USD 289.000	Lowe's 3% 15/10/2050	169.343	0,05
USD 70.000	Kilroy Realty 3,05% 15/2/2030	51.567	0,01	USD 50.000	Lowe's 3,5% 1/4/2051	31.743	0,01
USD 243.000	Kimco Realty 4,6% 1/2/2033	205.980	0,06	USD 155.000	Lowe's 3,7% 15/4/2046	107.052	0,03
USD 267.000	KLA 3,3% 1/3/2050	177.639	0,05	USD 95.000	Lowe's 4,25% 1/4/2052	69.397	0,02
USD 235.000	KLA 4,1% 15/3/2029	207.997	0,06	USD 105.000	Lowe's 4,65% 15/4/2042	84.654	0,02
USD 83.000	Kobe US Midco 2 9,25% 1/11/2026	55.942	0,02	USD 95.000	Lowe's 5% 15/4/2040	81.281	0,02
USD 104.000	Kontoor Brands 4,125% 15/11/2029	81.405	0,02	USD 215.000	Lowe's 5,125% 15/4/2050	180.833	0,05
USD 133.000	Korn Ferry 4,625% 15/12/2027	114.134	0,03	USD 77.000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	44.424	0,01
USD 88.000	Kraft Heinz Foods 3% 1/6/2026	76.403	0,02	USD 135.000	Madison IAQ 5,875% 30/6/2029	104.828	0,03
USD 45.000	Kraft Heinz Foods 4,375% 1/6/2046	34.361	0,01	USD 135.000	Marsh & McLennan 2,25% 15/11/2030	102.905	0,03
USD 598.000	Kraft Heinz Foods 4,875% 1/10/2049	489.345	0,13	USD 75.000	Marsh & McLennan 2,375% 15/12/2031	56.290	0,02
USD 23.000	Kraft Heinz Foods 5,2% 15/7/2045	19.497	0,01	USD 125.000	Mastercard 3,35% 26/3/2030	105.971	0,03
USD 6.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,25% 1/2/2027	5.007	0,00	USD 10.000	Mastercard 3,65% 1/6/2049	7.404	0,00
USD 12.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,75% 15/6/2029	9.307	0,00	USD 150.000	Mastercard 3,85% 26/3/2050	115.039	0,03
USD 7.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5,25% 1/10/2025	6.217	0,00	USD 105.000	Match II 3,625% 1/10/2031	78.721	0,02
USD 70.000	Lam Research 1,9% 15/6/2030	53.364	0,01	USD 47.000	Match II 4,125% 1/8/2030	37.197	0,01
USD 83.000	Lam Research 2,875% 15/6/2050	51.252	0,01	USD 80.000	Match II 4,625% 1/6/2028	68.003	0,02
USD 33.000	Lam Research 4,875% 15/3/2049	28.612	0,01	USD 24.000	Match II 5,625% 15/2/2029	20.877	0,01
USD 130.000	Lamb Weston 4,125% 31/1/2030	105.643	0,03	USD 21.000	Mattel 5,45% 1/11/2041	16.687	0,01
USD 141.000	Lamb Weston 4,375% 31/1/2032	112.572	0,03	USD 55.000	Mattel 6,2% 1/10/2040	47.403	0,01
USD 283.000	Lamb Weston 4,875% 15/5/2028	246.728	0,07	USD 360.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	326.383	0,09
USD 9.000	Legacy LifePoint Health 4,375% 15/2/2027	7.175	0,00	USD 6.000	Mauser Packaging Solutions 9,25% 15/4/2027	5.021	0,00
USD 147.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	124.050	0,04	USD 336.000	McAfee 7,375% 15/2/2030	271.286	0,07
USD 16.000	Level 3 Financing 3,625% 15/1/2029	8.793	0,00	USD 29.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	23.294	0,01
USD 157.000	Level 3 Financing 4,625% 15/9/2027	109.007	0,03	USD 171.000	Medline Borrower 5,25% 1/10/2029	140.347	0,04
USD 181.000	Level 3 Financing 10,5% 15/5/2030	169.557	0,05	USD 275.000	Mercedes-Benz Finance North America 0,75% 1/3/2024	247.330	0,07
USD 301.000	Levi Strauss 3,5% 1/3/2031	225.023	0,06	USD 395.000	Mercedes-Benz Finance North America 5,5% 27/11/2024	363.487	0,10
EUR 1.000.000	Liberty Mutual 3,625% 23/5/2059	954.540	0,26	USD 75.000	Merck 1,45% 24/6/2030	55.793	0,02
				USD 295.000	Merck 2,15% 10/12/2031	222.246	0,06
				USD 55.000	Merck 3,4% 7/3/2029	47.138	0,01
				USD 60.000	Merck 4% 7/3/2049	46.931	0,01
				USD 85.000	Merck 4,5% 17/5/2033	76.386	0,02
				USD 60.000	Merck 5% 17/5/2053	54.061	0,01
				USD 95.000	Merck 6,5% 1/12/2033	98.167	0,03
				USD 315.000	MetLife 3,85% 15/9/2025	268.446	0,07
				USD 75.000	MetLife 4,721% 15/12/2044	60.240	0,02
				USD 108.000	MGIC Investment 5,25% 15/8/2028	95.008	0,03
				USD 176.000	Microsoft 2,525% 1/6/2050	107.579	0,03
				USD 567.000	Microsoft 2,921% 17/3/2052	371.424	0,10
				USD 180.000	Microsoft 3,3% 6/2/2027	159.419	0,04
				USD 109.000	MicroStrategy 6,125% 15/6/2028	90.004	0,02

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 64.000	Mid-America Apartments 3,95% 15/3/2029	55.345	0,02	USD 345.000	Norfolk Southern 3,8% 1/8/2028	299.670	0,08
USD 85.891	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6,5% 20/6/2027	78.950	0,02	USD 160.000	Norfolk Southern 4,45% 1/3/2033	139.769	0,04
USD 78.000	ModivCare 5,875% 15/11/2025	68.288	0,02	USD 150.000	Norfolk Southern 5,05% 1/8/2030	136.759	0,04
USD 28.000	Molina Healthcare 3,875% 15/11/2030	22.074	0,01	USD 55.000	Norfolk Southern 5,35% 1/8/2054	49.345	0,01
USD 84.000	Molina Healthcare 4,375% 15/6/2028	71.293	0,02	USD 75.000	Northern Trust 3,15% 3/5/2029	62.952	0,02
USD 365.000	Morgan Stanley 1,512% 20/7/2027	298.521	0,08	USD 50.000	Northern Trust 3,95% 30/10/2025	44.588	0,01
USD 1.555.000	Morgan Stanley 1,593% 4/5/2027	1.285.940	0,35	USD 72.000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4,75% 30/4/2027	57.923	0,02
USD 100.000	Morgan Stanley 2,239% 21/7/2032	72.512	0,02	USD 480.000	Novelis 3,25% 15/11/2026	401.537	0,11
USD 70.000	Morgan Stanley 2,484% 16/9/2036	48.752	0,01	USD 400.000	Novelis 3,875% 15/8/2031	305.657	0,08
USD 295.000	Morgan Stanley 2,699% 22/1/2031	228.887	0,06	USD 55.000	NRG Energy 7% 15/3/2033	50.084	0,01
USD 60.000	Morgan Stanley 3,217% 22/4/2042	40.865	0,01	USD 260.000	Nucor 2% 1/6/2025	225.438	0,06
USD 270.000	Morgan Stanley 3,591% 22/7/2028	230.177	0,06	USD 295.000	Nucor 3,95% 23/5/2025	264.379	0,07
USD 580.000	Morgan Stanley 3,772% 24/1/2029	495.492	0,13	USD 155.000	NVIDIA 3,5% 1/4/2040	118.984	0,03
USD 300.000	Morgan Stanley 4,21% 20/4/2028	264.342	0,07	USD 185.000	Ohio Power 1,625% 15/1/2031	133.422	0,04
USD 175.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	160.177	0,04	USD 350.000	Ohio Power 4% 1/6/2049	253.315	0,07
USD 60.000	Motorola Solutions 2,3% 15/11/2030	44.092	0,01	USD 150.000	Ohio Power 5% 1/6/2033	134.775	0,04
USD 240.000	Motorola Solutions 4,6% 23/2/2028	214.093	0,06	EUR 407.000	Olympus Water US 9,625% 15/11/2028*	407.693	0,11
USD 40.000	Motorola Solutions 4,6% 23/5/2029	35.461	0,01	USD 300.000	Oncor Electric Delivery 2,7% 15/11/2051	170.447	0,05
USD 6.000	Motorola Solutions 5,5% 1/9/2044	5.068	0,00	USD 25.000	Oncor Electric Delivery 3,75% 1/4/2045	18.183	0,00
USD 4.000	Motorola Solutions 5,6% 1/6/2032	3.638	0,00	USD 380.000	Oncor Electric Delivery 3,8% 30/9/2047	274.877	0,07
USD 57.000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	46.411	0,01	USD 50.000	Oncor Electric Delivery 3,8% 1/6/2049	35.764	0,01
USD 175.000	Nasdaq 5,55% 15/2/2034	160.862	0,04	USD 168.000	Oncor Electric Delivery 4,3% 15/5/2028	150.021	0,04
USD 32.000	Nationstar Mortgage 5,75% 15/11/2031	25.323	0,01	USD 20.000	Oncor Electric Delivery 5,25% 30/9/2040	18.175	0,00
USD 39.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	34.272	0,01	USD 133.000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	95.595	0,03
USD 39.000	Navient 5,5% 15/3/2029	30.771	0,01	USD 12.000	OneMain Finance 5,375% 15/11/2029	9.622	0,00
USD 36.000	Navient 9,375% 25/7/2030	33.277	0,01	USD 71.000	OneMain Finance 6,875% 15/3/2025	65.183	0,02
USD 103.000	NCR 6,125% 1/9/2029	97.756	0,03	USD 71.000	OneMain Finance 7,125% 15/3/2026	64.505	0,02
USD 21.000	Neptune Bidco US 9,29% 15/4/2029	18.048	0,00	USD 33.000	OneMain Finance 9% 15/1/2029	30.847	0,01
USD 38.000	NESCO II 5,5% 15/4/2029	31.838	0,01	USD 123.000	Option Care Health 4,375% 31/10/2029	99.864	0,03
USD 119.000	Newmont 2,8% 1/10/2029	94.533	0,03	USD 375.000	Oracle 3,6% 1/4/2050	239.487	0,07
USD 93.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/7/2024	84.189	0,02	USD 27.000	Oracle 3,65% 25/3/2041	18.843	0,01
USD 283.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/9/2024	250.564	0,07	USD 95.000	Oracle 3,85% 15/7/2036	72.586	0,02
USD 90.000	NFP 4,875% 15/8/2028	74.136	0,02	USD 306.000	Oracle 3,95% 25/3/2051	206.058	0,06
USD 202.000	NFP 6,875% 15/8/2028*	164.063	0,04	USD 175.000	Oracle 4% 15/7/2046	121.203	0,03
USD 47.000	NFP 7,5% 1/10/2030	42.147	0,01	USD 135.000	Oracle 4,125% 15/5/2045	96.329	0,03
USD 110.000	Norfolk Southern 3,05% 15/5/2050	67.796	0,02	USD 60.000	Oracle 4,3% 8/7/2034	49.551	0,01
USD 65.000	Norfolk Southern 3,155% 15/5/2055	39.671	0,01	USD 70.000	Oracle 4,5% 8/7/2044	52.908	0,01
USD 90.000	Norfolk Southern 3,4% 1/11/2049	58.868	0,02	USD 415.000	Oracle 5,375% 15/7/2040	357.858	0,10
USD 125.000	Norfolk Southern 3,7% 15/3/2053	85.827	0,02	USD 35.000	Oracle 5,55% 6/2/2053	30.082	0,01
				EUR 1.019.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2,875% 30/4/2028*	906.757	0,25
				USD 200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4,125% 30/4/2028	166.869	0,05
				USD 209.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5,125% 30/4/2031	164.302	0,04

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 133.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,25% 15/1/2029	100.677	0,03	USD 12.000	RegionalCare Hospital Partners / LifePoint Health 9,75% 1/12/2026	10.317	0,00
USD 10.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	7.500	0,00	USD 135.000	Republic Services 2,3% 1/3/2030	105.475	0,03
USD 138.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	115.246	0,03	USD 130.000	Republic Services 3,95% 15/5/2028	113.719	0,03
USD 35.000	Owens-Brockway Glass Container 6,625% 13/5/2027	31.962	0,01	USD 57.000	Republic Services 4,875% 1/4/2029	51.774	0,01
USD 206.000	Owens-Brockway Glass Container 7,25% 15/5/2031	190.906	0,05	USD 16.000	Resideo Funding 4% 1/9/2029	12.346	0,00
USD 195.000	PacifiCorp 5,35% 1/12/2053	155.433	0,04	USD 21.000	Ritchie Bros 6,75% 15/3/2028	19.512	0,01
USD 192.000	Paramount Global 6,375% 30/3/2062	146.379	0,04	USD 69.000	Ritchie Bros 7,75% 15/3/2031	65.510	0,02
USD 71.000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4,5% 15/8/2028	59.756	0,02	USD 29.000	RLJ Lodging Trust 4% 15/9/2029	22.385	0,01
USD 341.000	PayPal 1,65% 1/6/2025	294.449	0,08	USD 310.000	Roche 2,607% 13/12/2051	185.023	0,05
USD 32.000	PayPal 3,25% 1/6/2050	20.998	0,01	USD 176.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	144.335	0,04
USD 76.000	PayPal 4,4% 1/6/2032	66.995	0,02	USD 14.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,875% 1/3/2031	10.467	0,00
USD 123.000	Pediatrix Medical 5,375% 15/2/2030	103.272	0,03	USD 19.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 4% 15/10/2033	13.849	0,00
USD 345.000	Pfizer 4% 15/12/2036	288.786	0,08	USD 575.000	Ryder System 3,65% 18/3/2024	523.587	0,14
USD 1.225.000	PNC Financial Services 3,4% 15/9/2026	858.169	0,23	USD 45.000	Ryder System 3,875% 1/12/2023	41.265	0,01
USD 9.000	Presidio 4,875% 1/2/2027	7.758	0,00	USD 486.000	Ryder System 5,65% 1/3/2028	448.839	0,12
USD 152.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5,75% 15/4/2026	137.666	0,04	USD 110.000	S&P Global 2,7% 1/3/2029	90.679	0,02
USD 97.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6,25% 15/1/2028	85.497	0,02	USD 125.000	S&P Global 2,9% 1/3/2032	98.853	0,03
USD 20.000	Progressive 3,7% 15/3/2052	14.132	0,00	USD 40.000	S&P Global 3,25% 1/12/2049	26.518	0,01
USD 100.000	Progressive 6,25% 1/12/2032	99.026	0,03	USD 87.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	78.898	0,02
USD 215.000	Prologis 2,875% 15/11/2029	173.517	0,05	USD 8.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	7.271	0,00
USD 103.000	Prologis 3,875% 15/9/2028	89.539	0,02	USD 250.000	Salesforce 2,7% 15/7/2041	164.429	0,04
USD 317.000	Prologis 5,125% 15/1/2034	287.715	0,08	USD 132.000	SBA Communications 3,125% 1/2/2029	104.086	0,03
USD 25.000	Prudential Financial 4,6% 15/5/2044	20.375	0,01	USD 276.000	SBA Communications 3,875% 15/2/2027	235.548	0,07
USD 138.000	PTC 3,625% 15/2/2025	123.028	0,03	EUR 116.000	SCIL IV / SCIL USA 8,1% 1/11/2026	115.878	0,03
USD 83.000	PTC 4% 15/2/2028	70.193	0,02	EUR 210.000	SCIL IV / SCIL USA 9,5% 15/7/2028*	213.739	0,06
USD 790.000	Public Service Electric and Gas 3,1% 15/3/2032	632.084	0,17	USD 139.000	Sealed Air 4% 1/12/2027	117.016	0,03
USD 609.000	Public Service Electric and Gas 4,65% 15/3/2033	544.334	0,15	USD 9.000	Sealed Air 5% 15/4/2029	7.692	0,00
USD 70.000	Public Service Electric and Gas 5,125% 15/3/2053	63.093	0,02	USD 53.000	Sealed Air/Sealed Air US 6,125% 1/2/2028	48.244	0,01
USD 191.000	QUALCOMM 4,3% 20/5/2047	152.719	0,04	USD 192.000	Sensata Technologies 4,375% 15/2/2030	156.648	0,04
USD 40.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4,5% 15/9/2026	28.801	0,01	USD 225.000	Sherwin-Williams 2,3% 15/5/2030	173.327	0,05
USD 83.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6,5% 15/9/2028	41.396	0,01	USD 844.000	Sherwin-Williams 3,125% 1/6/2024	763.575	0,21
USD 8.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,75% 15/1/2029	5.345	0,00	USD 25.000	Sherwin-Williams 3,3% 15/5/2050	15.672	0,00
USD 180.000	Realty Income 3% 15/1/2027	154.263	0,04	USD 67.000	Sherwin-Williams 3,45% 1/8/2025	59.442	0,02
USD 75.000	Realty Income 3,65% 15/1/2028	64.642	0,02	USD 52.000	Shift4 Payments 0% 15/12/2025	47.776	0,01
USD 175.000	Realty Income 3,875% 15/4/2025	157.027	0,04	USD 131.000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4,625% 1/11/2026	113.006	0,03
USD 100.000	Realty Income 4,85% 15/3/2030	89.233	0,02	USD 310.000	Simon Property 5,5% 8/3/2033	281.079	0,08
USD 280.000	Realty Income 5,625% 13/10/2032	257.988	0,07	USD 126.000	Sinclair Television 4,125% 1/12/2030	74.929	0,02
USD 231.000	Regal Rexnord 6,05% 15/4/2028	210.775	0,06	USD 108.000	Sirius XM Radio 3,125% 1/9/2026	89.412	0,02
USD 290.000	Regency Centers 2,95% 15/9/2029	230.847	0,06	USD 156.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	132.774	0,03
USD 330.000	Regency Centers 3,7% 15/6/2030	272.953	0,07	USD 111.000	Six Flags Entertainment 7,25% 15/5/2031	98.373	0,03
				USD 100.000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	92.230	0,03

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 111.000	SLM 3,125% 2/11/2026	91.153	0,02	USD 65.000	TTMT Escrow Issuer 8,625% 30/9/2027	61.819	0,02
USD 284.000	Sotheby's/Bidfair 5,875% 1/6/2029	202.455	0,06	USD 50.000	TWDC Enterprises 18 4,125% 1/6/2044	38.870	0,01
USD 114.000	Spectrum Brands 5% 1/10/2029	96.180	0,03	USD 33.000	Twilio 3,625% 15/3/2029	26.147	0,01
USD 42.000	SRS Distribution 4,625% 1/7/2028	34.531	0,01	USD 213.000	Twilio 3,875% 15/3/2031	165.129	0,04
USD 81.000	SRS Distribution 6% 1/12/2029	63.913	0,02	USD 237.000	Uber Technologies 0% 15/12/2025	204.495	0,06
USD 43.000	SRS Distribution 6,125% 1/7/2029	34.484	0,01	USD 176.000	Uber Technologies 4,5% 15/8/2029	148.926	0,04
USD 323.000	SS&C Technologies 5,5% 30/9/2027	287.180	0,08	USD 103.000	Uber Technologies 6,25% 15/1/2028	94.082	0,03
USD 30.000	Staples 7,5% 15/4/2026	22.942	0,01	USD 50.000	Uber Technologies 7,5% 15/5/2025	46.538	0,01
USD 13.000	Starwood Property Trust 4,375% 15/1/2027	10.749	0,00	USD 111.000	Uber Technologies 7,5% 15/9/2027	104.287	0,03
USD 92.000	Starwood Property Trust 4,75% 15/3/2025	82.102	0,02	USD 143.000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	134.299	0,04
USD 50.000	State Street 2,354% 1/11/2025	44.250	0,01	USD 50.000	Union Pacific 2,973% 16/9/2062	28.411	0,01
USD 50.000	State Street 3,776% 3/12/2024	45.822	0,01	USD 65.000	Union Pacific 3,55% 15/8/2039	48.751	0,01
USD 1.200.000	State Street 6,552% 15/6/2047	903.746	0,25	USD 120.000	Union Pacific 3,839% 20/3/2060	85.128	0,02
USD 210.000	Steel Dynamics 1,65% 15/10/2027	165.917	0,05	USD 115.000	Union Pacific 3,95% 15/8/2059	82.504	0,02
USD 72.000	Steel Dynamics 3,25% 15/10/2050	42.896	0,01	USD 140.000	Union Pacific 4,05% 1/3/2046	105.214	0,03
USD 35.000	Stericycle 3,875% 15/1/2029	28.174	0,01	USD 327.000	United Airlines 4,375% 15/4/2026	283.962	0,08
USD 61.000	Surgery Center 6,75% 1/7/2025*	56.227	0,02	USD 199.000	United Airlines 4,625% 15/4/2029	163.320	0,04
USD 134.000	Surgery Center 10% 15/4/2027	125.787	0,03	USD 95.000	United Natural Foods 6,75% 15/10/2028	72.986	0,02
USD 72.000	SWF Escrow Issuer 6,5% 1/10/2029	42.822	0,01	USD 410.000	United Rentals North America 6% 15/12/2029	376.017	0,10
USD 122.000	Synaptics 4% 15/6/2029	95.325	0,03	USD 295.000	UnitedHealth 2,75% 15/5/2040	196.169	0,05
USD 116.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	105.159	0,03	USD 98.000	UnitedHealth 3,25% 15/5/2051	64.284	0,02
USD 6.000	TEGNA 4,75% 15/3/2026	5.274	0,00	USD 445.000	UnitedHealth 3,5% 15/8/2039	334.458	0,09
USD 113.000	Teleflex 4,25% 1/6/2028	95.906	0,03	USD 135.000	UnitedHealth 4,2% 15/1/2047	105.475	0,03
USD 131.000	Teleflex 4,625% 15/11/2027	113.357	0,03	USD 185.000	UnitedHealth 4,5% 15/4/2033	164.291	0,04
USD 56.000	Tempur Sealy International 3,875% 15/10/2031	41.558	0,01	USD 105.000	UnitedHealth 4,75% 15/5/2052	88.260	0,02
USD 75.000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	59.623	0,02	USD 189.000	UnitedHealth 5,875% 15/2/2053	186.396	0,05
USD 97.000	Tenet Healthcare 4,875% 1/1/2026	86.737	0,02	USD 10.000	UnitedHealth 6,05% 15/2/2063	10.063	0,00
USD 38.000	Tenet Healthcare 5,125% 1/11/2027	33.389	0,01	USD 159.000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	146.068	0,04
USD 97.000	Tenet Healthcare 6,125% 1/10/2028	86.157	0,02	USD 17.000	Univision Communications 6,625% 1/6/2027	15.216	0,00
USD 142.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	126.923	0,03	USD 54.000	Univision Communications 7,375% 30/6/2030*	48.377	0,01
USD 94.000	Tenet Healthcare 6,25% 1/2/2027	85.467	0,02	USD 86.000	Univision Communications 8% 15/8/2028	79.384	0,02
USD 266.000	Tenet Healthcare 6,75% 15/5/2031	244.616	0,07	USD 1.440.000	US Bancorp 3,7% 15/1/2027	998.760	0,27
USD 67.000	Terex 5% 15/5/2029	56.757	0,02	USD 57.000	US Foods 4,625% 1/6/2030	46.724	0,01
USD 356.000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/10/2031	264.561	0,07	USD 41.000	US Foods 4,75% 15/2/2029	34.481	0,01
USD 140.000	Thermo Fisher Scientific 4,95% 21/11/2032	129.089	0,04	USD 80.000	US Foods 6,25% 15/4/2025	73.946	0,02
USD 34.000	Titan International 7% 30/4/2028	29.870	0,01	USD 144.000	Vail Resorts 6,25% 15/5/2025	132.421	0,04
USD 227.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	197.120	0,05	USD 155.000	Ventas Realty 3% 15/1/2030	121.441	0,03
USD 305.000	Toyota Motor Credit 1,15% 13/8/2027	243.266	0,07	USD 84.000	Veritas US / Veritas Bermuda 7,5% 1/9/2025	63.565	0,02
USD 325.000	Toyota Motor Credit 2,15% 13/2/2030	254.879	0,07	USD 240.000	Verizon Communications 1,5% 18/9/2030	172.845	0,05
USD 34.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	29.880	0,01	USD 91.000	Verizon Communications 2,55% 21/3/2031	69.019	0,02
USD 1.100.000	Truist Financial 4,95% 1/9/2025	944.146	0,26	USD 465.000	Verizon Communications 2,65% 20/11/2040	286.666	0,08
				USD 75.000	Verizon Communications 2,85% 3/9/2041	47.238	0,01
				USD 135.000	Verizon Communications 2,987% 30/10/2056	74.477	0,02
				USD 650.000	Verizon Communications 3,4% 22/3/2041	445.442	0,12

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 190.000	Verizon Communications 3,875% 8/2/2029	163.377	0,04	USD 1.116	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,05% Fixed; and receives/pays return on Hilton Worldwide) (15/9/2023)	154.934	0,04
USD 191.000	Verizon Communications 4,016% 3/12/2029	163.403	0,04	USD 199	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,1% Fixed; and receives/pays return on Everest) (28/9/2023)	66.285	0,02
USD 97.000	Verscend Escrow 9,75% 15/8/2026	88.923	0,02	USD 3.681	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,19% Fixed; and receives/pays return on Flex) (18/9/2023)	94.081	0,03
USD 210.000	Vertiv 4,125% 15/11/2028	173.965	0,05	USD 446	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,61% Fixed; and receives/pays return on Servicenow) (18/9/2023)	241.217	0,07
USD 65.000	Viavi Solutions 3,75% 1/10/2029	49.965	0,01	USD 5.174	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,17% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (15/9/2023)	641.341	0,18
USD 658.000	VMware 2,2% 15/8/2031	473.000	0,13	USD 46	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,39% Fixed; and receives/pays return on Booking) (27/9/2023)	132.215	0,04
USD 263.000	Voya Financial 6,125% 15/9/2023	240.210	0,07	USD 1.146	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,52% Fixed; and receives/pays return on Ebay) (18/9/2023)	47.237	0,01
USD 138.000	Wabash National 4,5% 15/10/2028	107.964	0,03	USD 273	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,95% Fixed; and receives/pays return on Parker-Hannifin) (26/9/2023)	106.098	0,03
USD 220.000	Walmart 2,65% 22/9/2051	136.905	0,04	USD 682	Royal Bank of Canada (Fund receives 15,51% Fixed; and receives/pays return on Cigna) (26/9/2023)	177.724	0,05
USD 460.000	Walt Disney 6,65% 15/11/2037	477.803	0,13	USD 1.873	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,03% Fixed; and receives/pays return on Walt Disney) (28/9/2023)	147.482	0,04
USD 10.000	Warnermedia 5,141% 15/3/2052	7.360	0,00	USD 2.301	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,55% Fixed; and receives/pays return on Borgwarner) (25/9/2023)	87.593	0,02
USD 5.000	Waste Management 1,5% 15/3/2031	3.595	0,00	USD 2.237	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,2% Fixed; and receives/pays return on Fidelity National Information Services) (25/9/2023)	116.584	0,03
USD 395.000	Welltower 3,85% 15/6/2032	319.952	0,09	USD 187	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,89% Fixed; and receives/pays return on United Rentals) (18/9/2023)	80.654	0,02
USD 291.000	WESCO Distribution 7,25% 15/6/2028	272.276	0,07	USD 814	Royal Bank of Canada (Fund receives 20,12% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	104.218	0,03
USD 290.000	Weyerhaeuser 4,75% 15/5/2026	262.993	0,07	EUR 2.706	Royal Bank of Canada (Fund receives 5,87% Fixed; and receives/pays return on Danone) (20/9/2023)	147.245	0,04
USD 156.000	William Carter 5,625% 15/3/2027	139.522	0,04	USD 1.576	Royal Bank of Canada (Fund receives 7,29% Fixed; and receives/pays return on Fiserv) (15/9/2023)	178.142	0,05
USD 165.000	Williams Scotsman International 4,625% 15/8/2028	138.414	0,04	USD 492	Royal Bank of Canada (Fund receives 8,87% Fixed; and receives/pays return on Becton Dickinson) (26/9/2023)	125.424	0,03
USD 36.000	WR Grace 4,875% 15/6/2027	30.988	0,00				
USD 69.000	WR Grace 5,625% 15/8/2029	53.522	0,01				
USD 37.000	WR Grace 7,375% 1/3/2031	33.701	0,01				
USD 237.000	WRKCo 3% 15/6/2033	176.992	0,05				
USD 147.000	WRKCo 4% 15/3/2028	126.559	0,04				
USD 150.000	WRKCo 4,9% 15/3/2029	132.938	0,04				
USD 79.000	Wyndham Hotels & Resorts 4,375% 15/8/2028	66.668	0,02				
USD 25.000	XPO Escrow Sub 7,5% 15/11/2027	23.453	0,01				
USD 538.000	Zayo 4% 1/3/2027	372.904	0,10				
USD 162.000	Zayo 6,125% 1/3/2028	97.135	0,03				
USD 377.000	ZoomInfo Technologies/ ZoomInfo Finance 3,875% 1/2/2029	295.698	0,08				
		193.490.913	52,70				
Total des obligations		289.585.543	78,86				
OBLIGATIONS INDEXÉES SUR DES ACTIONS							
USD 11.302	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,12% Fixed; and receives/pays return on AT&T) (15/9/2023)	154.552	0,04	USD 187	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,89% Fixed; and receives/pays return on United Rentals) (18/9/2023)	80.654	0,02
USD 441	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,37% Fixed; and receives/pays return on Thermo Fisher Scientific) (15/9/2023)	229.364	0,06	USD 814	Royal Bank of Canada (Fund receives 20,12% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	104.218	0,03
EUR 2.143	Royal Bank of Canada (Fund receives 11,23% Fixed; and receives/pays return on Publicis Groupe) (14/9/2023)	155.203	0,04	EUR 2.706	Royal Bank of Canada (Fund receives 5,87% Fixed; and receives/pays return on Danone) (20/9/2023)	147.245	0,04
USD 2.386	Royal Bank of Canada (Fund receives 11,55% Fixed; and receives/pays return on Starbucks) (25/9/2023)	219.347	0,06	USD 1.576	Royal Bank of Canada (Fund receives 7,29% Fixed; and receives/pays return on Fiserv) (15/9/2023)	178.142	0,05
				USD 492	Royal Bank of Canada (Fund receives 8,87% Fixed; and receives/pays return on Becton Dickinson) (26/9/2023)	125.424	0,03

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 1.845	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,03% Fixed; and receives/pays return on Otis Worldwide) (15/9/2023)	147.706	0,04	USD 45	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,7% Fixed; and receives/pays return on Autozone) (19/9/2023)	104.789	0,03
USD 456	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,31% Fixed; and receives/pays return on McKesson) (26/9/2023)	177.175	0,05	USD 608	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,97% Fixed; and receives/pays return on HCA Healthcare) (18/9/2023)	156.715	0,04
USD 795	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,48% Fixed; and receives/pays return on Automatic Data Processing) (15/9/2023)	187.244	0,05	USD 1.029	BNP Paribas (Fund receives 14,45% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/10/2023)	127.953	0,03
USD 342	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,49% Fixed; and receives/pays return on Humana) (25/9/2023)	149.419	0,04	USD 882	Societe Generale (Fund receives 0,2437% Fixed; and receives/pays return on Zimmer Biomet) (21/9/2023)	98.267	0,03
USD 3.861	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,71% Fixed; and receives/pays return on Apple) (27/9/2023)	669.470	0,18	USD 697	Societe Generale (Fund receives 0,382% Fixed; and receives/pays return on AmerisourceBergen) (25/9/2023)	114.899	0,03
USD 2.324	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,4% Fixed; and receives/pays return on JPMorgan Chase) (16/10/2023)	318.651	0,09	USD 2.309	Societe Generale (Fund receives 0,55% Fixed; and receives/pays return on Kraft Heinz) (25/9/2023)	71.136	0,02
USD 1.940	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,6% Fixed; and receives/pays return on Paccar) (14/9/2023)	148.627	0,04	USD 639	Societe Generale (Fund receives 0,6017% Fixed; and receives/pays return on Elevance Health) (11/9/2023)	269.159	0,07
USD 2.966	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,8% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (27/10/2023)	127.886	0,04	USD 3.328	Societe Generale (Fund receives 0,6387% Fixed; and receives/pays return on Synchrony Financial) (11/9/2023)	100.057	0,03
USD 508	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 11,37% Fixed; and receives/pays return on Vulcan Materials) (26/9/2023)	102.512	0,03	USD 699	Societe Generale (Fund receives 0,8533% Fixed; and receives/pays return on Arista Networks) (21/9/2023)	124.102	0,03
USD 1.294	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 12,02% Fixed; and receives/pays return on Johnson Controls International) (25/9/2023)	71.045	0,02	USD 4.035	Societe Generale (Fund receives 0,9047% Fixed; and receives/pays return on Ally Financial) (11/9/2023)	103.558	0,03
USD 1.801	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 13,62% Fixed; and receives/pays return on Gilead Sciences) (27/9/2023)	126.942	0,03	USD 4.080	Societe Generale (Fund receives 0,9963% Fixed; and receives/pays return on Mosaic) (25/9/2023)	148.534	0,04
USD 1.011	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 6,7% Fixed; and receives/pays return on Waste Management) (15/9/2023)	147.045	0,04	USD 1.456	Societe Generale (Fund receives 1,062% Fixed; and receives/pays return on Citizens Financial) (11/9/2023)	38.057	0,01
USD 1.686	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 6,73% Fixed; and receives/pays return on AbbVie) (18/9/2023)	231.322	0,06	USD 1.828	BNP Paribas (Fund receives 10,76% Fixed; and receives/pays return on UnitedHealth) (16/10/2023)	830.358	0,23
USD 2.338	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,36% Fixed; and receives/pays return on Nasdaq) (11/9/2023)	113.443	0,03	USD 3.315	BNP Paribas (Fund receives 11,3% Fixed; and receives/pays return on Citigroup) (16/10/2023)	127.474	0,03
USD 5.538	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,51% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (18/9/2023)	238.247	0,07	USD 1.731	BNP Paribas (Fund receives 12,46% Fixed; and receives/pays return on Kellogg) (26/9/2023)	98.156	0,03
USD 721	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,52% Fixed; and receives/pays return on YUM! Brands) (25/9/2023)	87.000	0,02	USD 107	BNP Paribas (Fund receives 13,12% Fixed; and receives/pays return on Equinix) (26/9/2023)	76.976	0,02

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 2.269	BNP Paribas (Fund receives 13,31% Fixed; and receives/pays return on Randstad) (20/9/2023)	122.994	0,03	USD 622	JP Morgan (Fund receives 6,14% Fixed; and receives/pays return on Walmart) (17/11/2023)	91.154	0,02
USD 990	BNP Paribas (Fund receives 14,07% Fixed; and receives/pays return on Voya Financial) (28/9/2023)	65.141	0,02	USD 636	JP Morgan (Fund receives 6,93% Fixed; and receives/pays return on Marsh & McLennan) (12/9/2023)	114.385	0,03
USD 1.770	BNP Paribas (Fund receives 15,35% Fixed; and receives/pays return on Best Buy) (22/11/2023)	125.505	0,03	EUR 2.535	JP Morgan (Fund receives 7,92% Fixed; and receives/pays return on SAP) (14/9/2023)	316.061	0,09
USD 438	BNP Paribas (Fund receives 16,01% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (27/9/2023)	132.385	0,04	USD 693	JP Morgan (Fund receives 9,93% Fixed; and receives/pays return on Travelers) (12/9/2023)	102.962	0,03
USD 242	BNP Paribas (Fund receives 16,89% Fixed; and receives/pays return on Palo Alto Networks) (17/11/2023)	52.553	0,01	USD 2.237	UBS (Fund receives 6,3% Fixed; and receives/pays return on Walmart) (2/10/2023)	331.216	0,09
USD 1.499	BNP Paribas (Fund receives 18,83% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	191.231	0,05	GBP 7.711	Barclays (Fund receives 10,42% Fixed; and receives/pays return on Unilever) (20/9/2023)	368.810	0,10
USD 1.171	BNP Paribas (Fund receives 27,09% Fixed; and receives/pays return on Comerica) (13/9/2023)	51.843	0,01	USD 1.151	Barclays (Fund receives 11,43% Fixed; and receives/pays return on Agilent Technologies) (29/9/2023)	129.944	0,04
USD 846	BNP Paribas (Fund receives 6,2% Fixed; and receives/pays return on McDonald's) (18/9/2023)	221.178	0,06	USD 381	Barclays (Fund receives 18,9% Fixed; and receives/pays return on Automation) (13/9/2023)	55.714	0,01
USD 501	BNP Paribas (Fund receives 8,1% Fixed; and receives/pays return on Stryker) (27/9/2023)	133.266	0,04	USD 5.087	Barclays (Fund receives 5,39% Fixed; and receives/pays return on Cisco Systems) (2/10/2023)	266.392	0,07
USD 3.252	BNP Paribas (Fund receives 8,37% Fixed; and receives/pays return on CVS Health) (25/9/2023)	200.078	0,05	USD 723	Goldman Sachs (Fund receives 10,35% Fixed; and receives/pays return on Starbucks) (2/11/2023)	65.191	0,02
USD 26	BNP Paribas (Fund receives 9,26% Fixed; and receives/pays return on Chipotle Mexican Grill) (18/9/2023)	46.360	0,01	USD 2.721	Goldman Sachs (Fund receives 11,79% Fixed; and receives/pays return on Target) (29/9/2023)	318.010	0,09
USD 758	BNP Paribas (Fund receives 9,95% Fixed; and receives/pays return on Zoetis) (27/9/2023)	133.664	0,04	USD 1.034	Goldman Sachs (Fund receives 16,03% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/10/2023)	130.468	0,04
EUR 1.238	BNP Paribas (Fund receives 9,98% Fixed; and receives/pays return on Essilorluxottica) (20/9/2023)	218.665	0,06	USD 325	Goldman Sachs (Fund receives 9,61% Fixed; and receives/pays return on Synopsys) (2/10/2023)	135.105	0,04
USD 2.013	JP Morgan (Fund receives 15,96% Fixed; and receives/pays return on Bank of America) (1/9/2023)	53.873	0,01	USD 1.949	Nomura (Fund receives 11,1% Fixed; and receives/pays return on Archer-Daniels-Midland) (14/9/2023)	144.234	0,04
USD 112	JP Morgan (Fund receives 17,49% Fixed; and receives/pays return on ServiceNow) (1/9/2023)	56.327	0,02	USD 4.905	Nomura (Fund receives 11,22% Fixed; and receives/pays return on Verizon Communications) (14/9/2023)	156.863	0,04
USD 1.679	JP Morgan (Fund receives 17,51% Fixed; and receives/pays return on Fortinet) (2/11/2023)	92.780	0,03	USD 2.443	Nomura (Fund receives 14,18% Fixed; and receives/pays return on Morgan Stanley) (8/9/2023)	192.178	0,05
USD 1.572	JP Morgan (Fund receives 5,29% Fixed; and receives/pays return on TJX) (29/9/2023)	133.038	0,04	USD 2.278	Nomura (Fund receives 14,81% Fixed; and receives/pays return on Charles Schwab) (8/9/2023)	125.395	0,03

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 1.261	Citigroup (Fund receives 10,23% Fixed; and receives/pays return on Kimberly-Clark) (14/9/2023)	149.972	0,04	USD 998	Citigroup (Fund receives 14,35% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (15/9/2023)	304.350	0,08
USD 399	Citigroup (Fund receives 10,46% Fixed; and receives/pays return on PPG Industries) (13/9/2023)	52.665	0,01	USD 12.149	Citigroup (Fund receives 14,51% Fixed; and receives/pays return on Bank of America) (8/9/2023)	324.639	0,09
USD 214	Citigroup (Fund receives 10,6% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (1/9/2023)	64.843	0,02	USD 3.110	Citigroup (Fund receives 15,38% Fixed; and receives/pays return on General Motors) (14/9/2023)	96.679	0,03
USD 390	Citigroup (Fund receives 10,74% Fixed; and receives/pays return on Apple) (1/9/2023)	65.922	0,02	USD 386	Citigroup (Fund receives 15,67% Fixed; and receives/pays return on Nucor) (14/9/2023)	61.226	0,02
USD 119	Citigroup (Fund receives 11,42% Fixed; and receives/pays return on UnitedHealth) (1/9/2023)	53.904	0,01	USD 556	Citigroup (Fund receives 16,42% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (1/9/2023)	66.031	0,02
USD 1.156	Citigroup (Fund receives 11,85% Fixed; and receives/pays return on Caterpillar) (21/9/2023)	302.620	0,08	USD 582	Citigroup (Fund receives 16,77% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (1/9/2023)	67.473	0,02
USD 6.936	Citigroup (Fund receives 12,05% Fixed; and receives/pays return on Pfizer) (21/9/2023)	229.856	0,06	USD 2.108	Citigroup (Fund receives 17,17% Fixed; and receives/pays return on Fifth Third Bancorp) (13/9/2023)	52.052	0,01
USD 455	Citigroup (Fund receives 12,65% Fixed; and receives/pays return on Eaton) (21/9/2023)	94.542	0,03	USD 1.779	Citigroup (Fund receives 21,35% Fixed; and receives/pays return on Freeport-McMoRan) (12/9/2023)	66.500	0,02
USD 1.436	Citigroup (Fund receives 12,98% Fixed; and receives/pays return on BJ's Wholesale Club) (17/11/2023)	89.027	0,02	USD 3.442	Citigroup (Fund receives 24,71% Fixed; and receives/pays return on First Horizon) (11/9/2023)	40.209	0,01
USD 409	Citigroup (Fund receives 13,09% Fixed; and receives/pays return on JP Morgan Chase) (1/9/2023)	55.038	0,02	USD 371	Citigroup (Fund receives 25,99% Fixed; and receives/pays return on Avis Budget) (21/9/2023)	74.783	0,02
USD 251	Citigroup (Fund receives 13,24% Fixed; and receives/pays return on Danaher) (1/9/2023)	54.938	0,02	USD 1.074	Citigroup (Fund receives 5% Fixed; and receives/pays return on Abbott Laboratories) (12/9/2023)	103.467	0,03
USD 1.241	Citigroup (Fund receives 13,25% Fixed; and receives/pays return on Toll Brothers) (27/10/2023)	92.296	0,03	USD 194	Citigroup (Fund receives 6,82% Fixed; and receives/pays return on McDonald's) (1/9/2023)	50.818	0,01
USD 1.315	Citigroup (Fund receives 13,38% Fixed; and receives/pays return on Bank of New York Mellon) (8/9/2023)	54.357	0,01	USD 1.317	Citigroup (Fund receives 8,16% Fixed; and receives/pays return on Sysco) (21/9/2023)	85.668	0,02
USD 682	Citigroup (Fund receives 13,49% Fixed; and receives/pays return on PNC Financial Services) (8/9/2023)	76.742	0,02	USD 647	Citigroup (Fund receives 8,57% Fixed; and receives/pays return on Danaher) (14/9/2023)	158.147	0,04
USD 2.669	Citigroup (Fund receives 14,15% Fixed; and receives/pays return on Flex) (26/10/2023)	66.547	0,02	USD 341	Citigroup (Fund receives 9,82% Fixed; and receives/pays return on Gartner) (21/9/2023)	110.127	0,03
USD 3.132	Citigroup (Fund receives 14,25% Fixed; and receives/pays return on Merck & Co) (21/9/2023)	313.965	0,09		Total des obligations indexées sur des actions	17.595.230	4,79
					Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	354.188.385	96,45

ESG Global Conservative Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Autres titres négociables			
ACTIONS ORDINAIRES			
	Luxembourg		
11.345	ADLER**	5.673	0,00
	Royaume-Uni		
1.484.818	Home Reit**	556.578	0,15
Total des actions ordinaires		562.251	0,15
Total des autres valeurs mobilières		562.251	0,15
Total du portefeuille		354.750.636	96,60
Autres éléments de l'actif net		12.468.220	3,40
Total de l'actif net (EUR)		367.218.856	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
AUD	1.093.106	EUR	684.097	Morgan Stanley	20/9/2023	(31.595)
CHF	341.537	EUR	356.478	Morgan Stanley	20/9/2023	289
EUR	10.522.608	GBP	9.057.903	UBS	20/9/2023	(53.226)
EUR	467.124	AUD	751.140	Bank of America	20/9/2023	18.749
EUR	159.564.956	USD	172.637.076	Standard Chartered Bank	20/9/2023	567.615
EUR	3.399.345	CHF	3.286.313	Goldman Sachs	20/9/2023	(33.514)
EUR	55.127	JPY	8.196.732	Deutsche Bank	20/9/2023	3.343
EUR	2.082.212	SEK	24.305.808	Deutsche Bank	20/9/2023	28.617
EUR	2.348.373	USD	2.611.817	HSBC Bank	20/9/2023	(57.089)
EUR	341.510	GBP	293.883	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(1.622)
EUR	10.298.935	GBP	8.870.000	Citigroup	15/9/2023	(59.777)
EUR	2.512.758	USD	2.750.000	RBS	15/9/2023	(20.583)
EUR	27.717	USD	30.000	Morgan Stanley	15/9/2023	80
EUR	138.263	USD	150.000	Barclays	15/9/2023	80
EUR	342.444	USD	370.000	HSBC Bank	15/9/2023	1.595
GBP	335.969	EUR	389.480	Standard Chartered Bank	20/9/2023	2.791
SEK	4.442.162	EUR	384.740	Goldman Sachs	20/9/2023	(9.422)
SEK	4.141.413	EUR	350.008	State Street	20/9/2023	(100)
USD	8.837.030	EUR	8.089.222	Goldman Sachs	20/9/2023	49.611
USD	2.162.747	EUR	1.982.063	Morgan Stanley	20/9/2023	9.809
USD	2.152.231	EUR	1.966.088	RBS	20/9/2023	16.100
USD	4.000.000	EUR	3.605.799	Deutsche Bank	20/9/2023	78.169
USD	2.024.693	EUR	1.854.436	JP Morgan	20/9/2023	10.290
Plus-value nette non réalisée						520.210
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 211.652.212)						520.210

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
542	USD	EUR/USD Future	Septembre 2023	67.794.010	(380)
5	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	928.618	25.116
744	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	76.043.125	647.510

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Conservative Income Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
(76)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	9.069.237	(141.741)
2	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	224.089	2.368
(4)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	393.770	(2.880)
Total				154.452.849	529.993

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
3.919	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.425	20/10/2023	(53.893)	136.103
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 4.833.605)						(53.893)	136.103

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
(3.919)	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.125	20/10/2023	34.143	(42.513)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 1.254.416)						34.143	(42.513)

ESG Global Multi-Asset Income Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				8.658	Pageseguro Digital	78.788	0,04
				994	Tencent	41.430	0,03
						860.311	0,51
COMPARTIMENTS							
Guernesey							
250.000	Bluefield Solar Income Fund	361.185	0,22	4.996	Asymchem Laboratories Tianjin	91.366	0,05
283.927	Syncona	477.974	0,28	20.000	China Merchants Bank	79.052	0,05
		839.159	0,50	11.000	China Merchants Bank	47.702	0,03
				2.834	Contemporary Ampere Technology		
Irlande							
1.558.681	iShares EUR Corp Bond ESG Paris-Aligned Climate UCITS ETF-	8.101.304	4,85	14.400	Ganfeng Lithium	92.145	0,06
243.836	iShares Green Bond Index Fund IE-	2.342.579	1,40	11.900	Haier Smart Home	68.852	0,04
		10.443.883	6,25	15.029	Haier Smart Home	46.469	0,03
Jersey							
263.389	Foresight Solar Fund	309.845	0,19	132.000	Industrial & Commercial Bank of China	60.589	0,03
Luxembourg							
2.805	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Impact Bond Fund*	27.573	0,02	13.940	LONGi Green Energy Technology	50.871	0,03
Royaume-Uni							
773.007	Greencoat UK Wind Fund	1.389.502	0,83	17.758	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	72.493	0,04
316.310	Gresham House Energy Storage Fund	533.176	0,32			647.993	0,38
		1.922.678	1,15	Danemark			
Total des Compartiments				3.656	Novo Nordisk	680.162	0,41
		13.543.138	8,11	1.511	Orsted	97.039	0,06
				8.981	Tryg	171.750	0,10
						948.951	0,57
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Australie							
7.120	NEXTDC	62.446	0,04	Finlande			
12.311	Transurban	105.742	0,06	3.975	Sampo	175.956	0,10
		168.188	0,10	3.209	UPM-Kymmene	110.645	0,07
						286.601	0,17
Belgique							
580	Aedifica	38.826	0,02	France			
2.248	Azelis	49.364	0,03	865	Aéroports de Paris	115.620	0,07
		88.190	0,05	2.368	Air Liquide	432.491	0,26
Brésil							
5.502	Arezzo Industria e Comercio	82.003	0,05	1.781	ALD	17.352	0,01
29.951	B3 - Brasil Bolsa Balcao	79.150	0,05	1.626	BNP Paribas	105.935	0,06
20.958	Banco Bradesco	63.595	0,04	480	Capgemini	90.589	0,06
154.711	Hapvida Participacoes e Investimentos	138.168	0,08	2.361	Cie de Saint-Gobain	153.770	0,09
39.180	Sendas Distribuidora	94.633	0,06	2.352	EssilorLuxottica	448.809	0,27
		457.549	0,28	5.872	Getlink	98.652	0,06
Canada							
4.467	Boralex	109.227	0,07	60	Hermes International	124.817	0,07
1.507	Canadian Pacific Kansas City	120.172	0,07	521	Kering	281.752	0,17
3.127	Hydro One	84.019	0,05	242	L'Oreal	107.753	0,07
25.328	TELUS	448.763	0,27	7.003	Sanofi	756.064	0,45
		762.181	0,46	594	Schneider Electric	102.778	0,06
				1.755	Vinci	197.339	0,12
						3.033.721	1,82
Îles Caïmans							
23.600	Alibaba	271.417	0,16	Allemagne			
1.008	Alibaba	93.502	0,06	1.089	Fraport Frankfurt Airport Services Worldwide	58.721	0,04
4.000	Baidu	71.095	0,04	291	Merck	52.693	0,03
267	Baidu	38.112	0,02	761	SAP	107.317	0,06
24.000	China Mengniu Dairy	80.785	0,05	1.361	Siemens	205.751	0,12
5.586	IHS	41.448	0,02			424.482	0,25
3.047	Kanzhun	46.193	0,03	Hong Kong			
5.671	KE	97.541	0,06	10.200	AIA	92.597	0,06
				63.765	Hang Lung Properties	85.205	0,05
						177.802	0,11
Hongrie							
				2.543	OTP Bank	104.398	0,06
Inde							
				35.420	Aditya Birla Capital	77.505	0,05
				1.311	Alkem Laboratories	57.688	0,03
				588	Axis Bank	6.914	0,01
				2.400	Axis Bank	141.120	0,08

* Participation croisée d'un fonds à compartiments multiples et investissement dans le fonds d'une partie liée, pour de plus amples informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
États-Unis				USD 362.000	Bombardier 7,875% 15/4/2027	361.488	0,22
3.709	AbbVie	551.194	0,33	USD 20.000	Canadian National Railway 3,85% 5/8/2032	18.476	0,01
499	Alexandria Real Estate Equities	58.558	0,04	USD 20.000	Canadian National Railway 4,45% 20/1/2049	17.643	0,01
10.750	Allstate	216.505	0,13	USD 25.000	Canadian Pacific Railway 3,1% 2/12/2051	17.021	0,01
2.051	American Express	328.632	0,20	USD 19.000	Garda World Security 4,625% 15/2/2027	17.594	0,01
751	American Tower	137.080	0,08	USD 80.000	Garda World Security 7,75% 15/2/2028	79.881	0,05
4.267	Apple	802.452	0,48	USD 10.000	Garda World Security 9,5% 1/11/2027	9.676	0,01
2.285	Assurant	317.683	0,19	USD 142.000	GFL Environmental 3,5% 1/9/2028	125.716	0,07
7.636	Carrier Global	440.674	0,26	USD 13.000	GFL Environmental 3,75% 1/8/2025	12.399	0,01
11.339	Citizens Financial	319.306	0,19	USD 52.000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	46.665	0,03
6.557	Clearway Energy	163.597	0,10	USD 14.000	GFL Environmental 4,25% 1/6/2025	13.558	0,01
1.567	Cognizant Technology Solutions	112.338	0,07	USD 75.000	GFL Environmental 4,375% 15/8/2029	66.730	0,04
211	Consolidated Edison	19.001	0,01	USD 175.000	GFL Environmental 4,75% 15/6/2029	160.486	0,10
3.641	CSX	110.759	0,07	USD 18.000	GFL Environmental 5,125% 15/12/2026	17.436	0,01
309	Digital Realty Trust	40.674	0,02	USD 149.000	Jones Deslauriers Insurance Management 8,5% 15/3/2030	152.239	0,09
360	EPAM Systems	92.862	0,05	USD 59.000	Jones Deslauriers Insurance Management 10,5% 15/12/2030	60.121	0,04
131	Equinix	103.382	0,06	USD 46.000	Nutrien 4,9% 27/3/2028	44.935	0,03
1.467	Eversource Energy	94.753	0,05	USD 10.000	Nutrien 5,8% 27/3/2053	9.773	0,00
3.195	Exelon	129.589	0,08	USD 65.000	Nutrien 5,9% 7/11/2024	64.978	0,04
4.737	Intercontinental Exchange	558.919	0,34	USD 267.000	Open Text 6,9% 1/12/2027	271.046	0,16
3.033	Microsoft	998.039	0,60	USD 25.000	Rogers Communications 3,7% 15/11/2049	17.015	0,01
8.702	Mondelez International	619.844	0,37	USD 110.000	Rogers Communications 3,8% 15/3/2032	93.850	0,06
4.503	Oracle	544.413	0,32	USD 50.000	Rogers Communications 4,1% 1/10/2023	49.919	0,03
5.304	Otis Worldwide	459.167	0,28	USD 6.000	Rogers Communications 4,3% 15/2/2048	4.504	0,00
4.363	Paychex	533.115	0,32	USD 4.000	Rogers Communications 4,35% 1/5/2049	3.031	0,00
4.178	Physicians Realty Trust	58.325	0,04	USD 93.000	Rogers Communications 4,55% 15/3/2052	72.035	0,04
2.772	Republic Services	404.047	0,24	USD 50.000	Toronto-Dominion Bank/The 0,7% 10/9/2024	47.560	0,03
900	SBA Communications	204.844	0,12	USD 29.000	Toronto-Dominion Bank/The 1,25% 10/9/2026	25.697	0,02
1.700	SLM	104.550	0,06	USD 60.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,65% 12/6/2024	58.569	0,03
6.380	Synchrony Financial	207.414	0,12	USD 18.000	Toronto-Dominion Bank/The 3,625% 15/9/2031	16.810	0,01
1.292	Union Pacific	287.483	0,17	USD 25.000	Toronto-Dominion Bank/The 5,156% 10/1/2028	24.740	0,01
2.528	United Parcel Service	435.018	0,26	USD 50.000	Toronto-Dominion Bank/The 5,532% 17/7/2026	50.076	0,03
1.176	UnitedHealth	576.240	0,35	USD 336.000	TransAlta 7,75% 15/11/2029	346.156	0,21
		10.030.457	6,00			3.323.407	1,99
Total des actions ordinaires et privilégiées		35.629.942	21,32				
OBLIGATIONS							
Australie							
USD 28.000	Westpac Banking 2,668% 15/11/2035	21.531	0,01	USD 6.000	Rogers Communications 4,3% 15/2/2048	4.504	0,00
USD 46.000	Westpac Banking 3,133% 18/11/2041	30.059	0,02	USD 4.000	Rogers Communications 4,35% 1/5/2049	3.031	0,00
USD 14.000	Westpac Banking 5,405% 10/8/2033	13.180	0,01	USD 93.000	Rogers Communications 4,55% 15/3/2052	72.035	0,04
		64.770	0,04	USD 50.000	Toronto-Dominion Bank/The 0,7% 10/9/2024	47.560	0,03
Canada							
USD 139.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,875% 15/1/2028	126.610	0,08	USD 29.000	Toronto-Dominion Bank/The 1,25% 10/9/2026	25.697	0,02
USD 83.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	70.692	0,04	USD 60.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,65% 12/6/2024	58.569	0,03
USD 137.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4,375% 15/1/2028	125.895	0,08	USD 18.000	Toronto-Dominion Bank/The 3,625% 15/9/2031	16.810	0,01
USD 86.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 5,75% 15/4/2025	85.469	0,05	USD 25.000	Toronto-Dominion Bank/The 5,156% 10/1/2028	24.740	0,01
USD 11.000	ATS 4,125% 15/12/2028	9.789	0,00	USD 50.000	Toronto-Dominion Bank/The 5,532% 17/7/2026	50.076	0,03
USD 22.000	Bank of Nova Scotia/The 1,35% 24/6/2026	19.649	0,01	USD 336.000	TransAlta 7,75% 15/11/2029	346.156	0,21
USD 28.000	Bank of Nova Scotia/The 1,45% 10/1/2025	26.484	0,02				
USD 25.000	Bank of Nova Scotia/The 2,951% 11/3/2027	23.076	0,01				
USD 71.000	Bombardier 6% 15/2/2028	66.370	0,04	USD 11.000	GGAM Finance 7,75% 15/5/2026	11.057	0,00
USD 270.000	Bombardier 7,125% 15/6/2026	265.695	0,16	USD 11.000	GGAM Finance 8% 15/6/2028	11.159	0,01
USD 4.000	Bombardier 7,5% 15/3/2025	4.004	0,00	USD 43.653	Global Aircraft Leasing 6,5% 15/9/2024	40.973	0,03
USD 124.000	Bombardier 7,5% 1/2/2029	121.851	0,07				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 107.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	112.430	0,07	USD 52.000	Medtronic Global 4,5% 30/3/2033	50.323	0,03
USD 169.000	Seagate HDD Cayman 8,5% 15/7/2031	177.164	0,10	USD 57.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	47.346	0,03
		352.783	0,21	USD 80.000	Telecom Italia Capital 6,375% 15/11/2033	69.994	0,04
	Danemark			USD 3.000	Telecom Italia Capital 7,2% 18/7/2036	2.700	0,00
USD 345.000	Danske Bank 7% 26/6/2025	329.419	0,20	USD 10.000	Telecom Italia Capital 7,721% 4/6/2038	9.209	0,01
	Finlande			USD 200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5,5% 1/3/2028	183.800	0,11
USD 500.000	Nordea Bank 6,625% 26/3/2026	474.993	0,28			1.136.792	0,68
	France				Pays-Bas		
USD 200.000	Alice France 5,125% 15/7/2029	142.261	0,09	USD 319.000	Elastic 4,125% 15/7/2029	274.698	0,16
USD 200.000	BNP Paribas 4,625% 25/2/2031	146.032	0,08	USD 200.000	Enel Finance International 1,375% 12/7/2026	177.260	0,11
USD 200.000	BNP Paribas 8,5% 14/8/2028	200.060	0,12	USD 200.000	ING Groep 3,875% 16/5/2027	149.030	0,09
USD 619.000	Constellium 3,75% 15/4/2029	532.073	0,32	USD 200.000	ING Groep 4,625% 6/1/2026	195.201	0,11
USD 250.000	Credit Agricole 4,75% 23/3/2029	196.206	0,12	USD 150.000	JDE Peet's 1,375% 15/1/2027	130.215	0,08
USD 200.000	Iliad 6,5% 15/10/2026	190.734	0,11	USD 88.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2,5% 11/5/2031	71.043	0,04
USD 200.000	Iliad 7% 15/10/2028	186.331	0,11	USD 13.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2,65% 15/2/2032	10.414	0,01
		1.593.697	0,95	USD 38.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,25% 11/5/2041	27.077	0,02
	Allemagne			USD 8.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,4% 1/5/2030	7.018	0,00
USD 200.000	Allianz 3,5% 17/11/2025	167.997	0,10	USD 18.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4,3% 18/6/2029	16.858	0,01
USD 400.000	Deutsche Bank 6% 30/10/2025	323.583	0,19	USD 52.000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	45.788	0,03
USD 200.000	Deutsche Bank 7,079% 10/2/2034	190.559	0,11	USD 11.000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	10.733	0,01
		682.139	0,40	USD 9.000	Sensata Technologies 5,625% 1/11/2024	8.920	0,01
	Irlande			USD 313.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3,15% 1/10/2026	283.475	0,17
USD 150.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 5,75% 6/6/2028	148.573	0,09	USD 298.000	Trivium Packaging Finance 8,5% 15/8/2027	282.957	0,17
	Italie			USD 314.000	Ziggo Bond 5,125% 28/2/2030	243.696	0,14
USD 339.000	UniCredit 8% 3/6/2024	334.339	0,20			1.934.383	1,16
	Japon				Singapour		
USD 12.000	Honda Motor 2,967% 10/3/2032	10.495	0,01	USD 45.000	Pfizer Investment Enterprises 4,65% 19/5/2030	44.330	0,03
USD 300.000	Mitsubishi UFJ Financial 0,953% 19/7/2025	286.630	0,17	USD 79.000	Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	77.818	0,05
USD 56.000	Sumitomo Mitsui Financial 2,632% 14/7/2026	51.668	0,03	USD 75.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	75.155	0,04
USD 59.000	Sumitomo Mitsui Financial 3,544% 17/1/2028	54.391	0,03			197.303	0,12
USD 25.000	Sumitomo Mitsui Financial 3,944% 19/7/2028	23.338	0,02		Espagne		
		426.522	0,26	USD 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6,125% 16/11/2027	171.489	0,10
	Jersey				Suisse		
USD 40.000	Aptiv 3,1% 1/12/2051	24.414	0,02	USD 250.000	Credit Suisse 1,25% 7/8/2026	218.693	0,13
USD 35.000	Aptiv / Aptiv 3,25% 1/3/2032	29.687	0,02	USD 500.000	UBS 3,875% 2/6/2026	411.742	0,25
USD 25.000	Aptiv / Aptiv 4,15% 1/5/2052	18.589	0,01	USD 250.000	UBS 9,016% 15/11/2033	303.169	0,18
		72.690	0,05			933.604	0,56
	Luxembourg				Royaume-Uni		
USD 200.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	169.180	0,10	USD 200.000	Barclays 3,932% 7/5/2025	197.091	0,12
USD 116.000	Camelot Finance 4,5% 1/11/2026	108.704	0,06	USD 200.000	Barclays 4,375% 12/1/2026	192.776	0,12
USD 316.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	299.952	0,18	USD 300.000	Barclays 6,125% 15/12/2025	266.590	0,16
USD 200.000	Herens Holdco 4,75% 15/5/2028	153.834	0,09	USD 255.000	Barclays 8% 15/3/2029	227.666	0,14
USD 43.000	Medtronic Global 4,25% 30/3/2028	41.750	0,03	USD 200.000	HSBC 4,583% 19/6/2029	188.465	0,11

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 50.000	American Honda Finance 2,9% 16/2/2024	49.333	0,03	USD 19.000	Asbury Automotive 4,5% 1/3/2028	17.346	0,01
USD 67.000	American Tower 1,6% 15/4/2026	60.497	0,04	USD 17.000	Asbury Automotive 4,75% 1/3/2030	14.903	0,01
USD 24.000	American Tower 1,875% 15/10/2030	18.693	0,01	USD 21.000	Asbury Automotive 5% 15/2/2032	18.001	0,01
USD 57.000	American Tower 2,1% 15/6/2030	45.507	0,03	USD 160.000	Ashland 3,375% 1/9/2031	128.258	0,08
USD 28.000	American Tower 2,3% 15/9/2031	21.925	0,01	USD 54.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	46.567	0,03
USD 22.000	American Tower 2,7% 15/4/2031	17.998	0,01	USD 10.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6,625% 15/1/2028	9.586	0,01
USD 3.000	American Tower 2,9% 15/1/2030	2.558	0,00	USD 3.000	Astrazeneca Finance 2,25% 28/5/2031	2.497	0,00
USD 40.000	American Tower 3,375% 15/10/2026	37.454	0,02	USD 25.000	AT&T 2,55% 1/12/2033	19.085	0,01
USD 5.000	American Tower 3,55% 15/7/2027	4.636	0,00	USD 30.000	AT&T 3,5% 1/6/2041	22.028	0,01
USD 30.000	American Tower 3,8% 15/8/2029	27.268	0,02	USD 25.000	AT&T 3,5% 15/9/2053	16.459	0,01
USD 22.000	American Tower 3,95% 15/3/2029	20.209	0,01	USD 45.000	AT&T 3,65% 1/6/2051	30.902	0,02
USD 2.000	Amgen 2% 15/1/2032	1.570	0,00	USD 35.000	AT&T 3,65% 15/9/2059	22.691	0,01
USD 12.000	Amgen 2,45% 21/2/2030	10.211	0,01	USD 139.000	AT&T 4,5% 15/5/2035	123.496	0,07
USD 5.000	Amgen 2,77% 1/9/2053	2.996	0,00	USD 243.000	AthenaHealth 6,5% 15/2/2030	210.730	0,13
USD 53.000	Amgen 3% 15/1/2052	34.596	0,02	USD 43.000	Autodesk 2,4% 15/12/2031	34.916	0,02
USD 10.000	Amgen 4,2% 22/2/2052	7.982	0,00	USD 50.000	Autodesk 3,5% 15/6/2027	47.194	0,03
USD 16.000	Amgen 4,4% 22/2/2062	12.731	0,01	USD 20.000	AvalonBay Communities 5% 15/2/2033	19.827	0,01
USD 63.000	Amgen 4,875% 1/3/2053	56.049	0,03	USD 163.000	Avantor Funding 3,875% 1/11/2029	142.967	0,09
USD 25.000	Amgen 5,15% 2/3/2028	24.957	0,01	USD 292.000	Avantor Funding 4,625% 15/7/2028	271.233	0,16
USD 57.000	Amgen 5,25% 2/3/2033	56.726	0,03	USD 70.000	Aviation Capital 1,95% 20/9/2026	61.580	0,04
USD 25.000	Amgen 5,65% 2/3/2053	24.855	0,01	USD 39.000	Avient 7,125% 1/8/2030	39.087	0,02
USD 10.000	Amgen 5,75% 2/3/2063	9.884	0,01	USD 391.000	Axalta Coating Systems 3,375% 15/2/2029	331.961	0,20
USD 128.000	AMN Healthcare 4% 15/4/2029	109.562	0,07	USD 422.000	Axalta Coating Systems / Axalta Coating Systems Dutch B 4,75% 15/6/2027	397.291	0,24
USD 104.000	AMN Healthcare 4,625% 1/10/2027	95.320	0,06	USD 291.000	Ball 3,125% 15/9/2031	236.205	0,14
USD 41.000	AmWINS 4,875% 30/6/2029	36.814	0,02	USD 163.000	Ball 4,875% 15/3/2026	158.403	0,09
USD 5.000	Analog Devices 1,7% 1/10/2028	4.285	0,00	USD 70.000	Ball 6% 15/6/2029	68.953	0,04
USD 17.000	Analog Devices 2,8% 1/10/2041	12.101	0,01	USD 80.000	Bank of America 1,898% 23/7/2031	63.214	0,04
USD 67.000	ANGI 3,875% 15/8/2028	53.622	0,03	USD 95.000	Bank of America 2,299% 21/7/2032	74.986	0,05
USD 107.200	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	97.444	0,06	USD 28.000	Bank of America 2,651% 11/3/2032	22.936	0,01
USD 16.000	API DE 4,125% 15/7/2029	13.842	0,01	USD 34.000	Bank of America 2,687% 22/4/2032	27.830	0,02
USD 14.000	API DE 4,75% 15/10/2029	12.672	0,01	USD 10.000	Bank of America 2,884% 22/10/2030	8.576	0,01
USD 87.000	Apple 2,2% 11/9/2029	76.027	0,05	USD 164.000	Bank of America 2,972% 4/2/2033	134.902	0,08
USD 19.000	Apple 2,65% 8/2/2051	12.642	0,01	USD 67.000	Bank of America 3,419% 20/12/2028	61.389	0,04
USD 33.000	Apple 2,7% 5/8/2051	22.008	0,01	USD 70.000	Bank of America 3,593% 21/7/2028	65.078	0,04
USD 20.000	Apple 2,95% 11/9/2049	14.293	0,01	USD 70.000	Bank of America 4,271% 23/7/2029	66.048	0,04
USD 5.000	Apple 3,45% 9/2/2045	4.058	0,00	USD 50.000	Bank of America 4,571% 27/4/2033	46.370	0,03
USD 39.000	Apple 3,85% 4/8/2046	33.096	0,02	USD 27.000	Bank of America 4,75% 21/4/2045	24.312	0,01
USD 8.000	Apple 4,5% 23/2/2036	8.006	0,00	USD 150.000	Bank of America 4,948% 22/7/2028	146.961	0,09
USD 65.000	Apple 4,65% 23/2/2046	62.185	0,04	USD 140.000	Bank of America 6,204% 10/11/2028	143.095	0,09
USD 13.000	Applied Materials 3,3% 1/4/2027	12.321	0,01	USD 14.000	Bank of New York Mellon 3% 30/10/2028	12.588	0,01
USD 99.000	APX 5,75% 15/7/2029	85.471	0,05	USD 259.000	Bank of New York Mellon 3,7% 20/3/2026	232.824	0,14
USD 145.000	APX 6,75% 15/2/2027	140.462	0,08				
USD 35.000	Aramark Services 5% 1/4/2025	34.600	0,02				
USD 291.000	Aramark Services 5% 1/2/2028	271.824	0,16				
USD 135.000	Aramark Services 6,375% 1/5/2025	135.495	0,08				
USD 400.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	325.188	0,19				
USD 200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	196.077	0,12				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 325.000	Bank of New York Mellon 4,625% 20/9/2026	290.447	0,17	USD 4.000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	3.739	0,00
USD 3.000	Baxalta 5,25% 23/6/2045	2.812	0,00	USD 196.000	CCO / CCO Capital 4,25% 1/2/2031	161.380	0,10
USD 45.000	Baxter International 2,539% 1/2/2032	36.158	0,02	USD 46.000	CCO / CCO Capital 4,25% 15/1/2034	35.275	0,02
USD 200.000	Bayer US Finance II 4,375% 15/12/2028	189.897	0,11	USD 103.000	CCO / CCO Capital 4,5% 15/8/2030	86.832	0,05
USD 32.000	Beacon Roofing Supply 4,125% 15/5/2029	27.589	0,02	USD 16.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/3/2030	13.811	0,01
USD 58.000	Beacon Roofing Supply 6,5% 1/8/2030	57.198	0,03	USD 62.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/2/2032	51.473	0,03
USD 17.000	Becton Dickinson 3,7% 6/6/2027	16.084	0,01	USD 60.000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	55.346	0,03
USD 72.000	Becton Dickinson 3,734% 15/12/2024	70.255	0,04	USD 10.000	CCO / CCO Capital 5,125% 1/5/2027	9.434	0,01
USD 12.000	Becton Dickinson 4,669% 6/6/2047	10.658	0,01	USD 15.000	CCO / CCO Capital 5,375% 1/6/2029	13.712	0,01
USD 5.000	Becton Dickinson 4,685% 15/12/2044	4.433	0,00	USD 104.000	CCO / CCO Capital 6,375% 1/9/2029	98.691	0,06
USD 119.000	Berry Global 1,57% 15/1/2026	108.271	0,06	USD 380.000	CCO / CCO Capital 7,375% 1/3/2031	378.075	0,23
USD 197.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	196.142	0,12	USD 101.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,5% 1/5/2025	100.336	0,06
USD 149.000	Black Knight InfoServ 3,625% 1/9/2028	138.197	0,08	USD 119.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 6,5% 1/10/2028	115.218	0,07
USD 70.000	Block 2,75% 1/6/2026	63.604	0,04	USD 2.000	Centene 2,5% 1/3/2031	1.592	0,00
USD 579.000	Block 3,5% 1/6/2031	476.120	0,28	USD 79.000	Centene 3% 15/10/2030	65.646	0,04
USD 57.000	Boise Cascade 4,875% 1/7/2030	51.463	0,03	USD 55.000	Centene 3,375% 15/2/2030	47.097	0,03
USD 74.000	Boxer Parent 9,125% 1/3/2026	74.129	0,04	USD 50.000	Centene 4,625% 15/12/2029	45.983	0,03
USD 15.000	Boyne USA 4,75% 15/5/2029	13.537	0,01	USD 20.000	CenterPoint Energy Houston Electric 3% 1/3/2032	17.122	0,01
USD 14.000	Brink's 4,625% 15/10/2027	13.055	0,01	USD 27.000	CenterPoint Energy Houston Electric 4,95% 1/4/2033	26.568	0,02
USD 5.000	Brink's 5,5% 15/7/2025	4.927	0,00	USD 239.000	Central Parent / CDK Global 7,25% 15/6/2029	236.196	0,14
USD 40.000	Bristol-Myers Squibb 2,9% 26/7/2024	39.090	0,02	USD 113.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	114.526	0,07
USD 12.000	Bristol-Myers Squibb 2,95% 15/3/2032	10.395	0,01	USD 30.000	Charles River Laboratories International 4% 15/3/2031	25.928	0,02
USD 6.000	Bristol-Myers Squibb 3,9% 15/3/2062	4.555	0,00	USD 182.000	Charles River Laboratories International 4,25% 1/5/2028	167.036	0,10
USD 50.000	Broadcom 3,419% 15/4/2033	41.488	0,02	USD 320.000	Charles Schwab 4% 1/6/2026	276.432	0,17
USD 25.000	Broadcom 4,15% 15/4/2032	22.399	0,01	USD 213.000	Charles Schwab 4% 1/12/2030	160.016	0,10
USD 134.000	Broadcom 4,926% 15/5/2037	120.554	0,07	USD 200.000	Charles Schwab 5% 1/6/2027	173.554	0,10
USD 23.000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGSi Sellco LL 4,5% 1/4/2027	19.232	0,01	USD 40.000	Charles Schwab 5,875% 24/8/2026	40.229	0,02
USD 24.000	Cable One 0% 15/3/2026	19.846	0,01	USD 25.000	Charles Schwab 6,136% 24/8/2034	25.472	0,02
USD 148.000	Cable One 1,125% 15/3/2028	112.224	0,07	USD 31.000	Chemours 4,625% 15/11/2029	25.797	0,02
USD 116.000	Cable One 4% 15/11/2030	90.577	0,05	USD 7.000	Chemours 5,75% 15/11/2028	6.274	0,00
USD 200.000	Cablevision Lightpath 5,625% 15/9/2028	153.924	0,09	USD 103.000	Chobani / Chobani Finance 4,625% 15/11/2028	92.516	0,06
USD 14.000	Camden Property Trust 2,8% 15/5/2030	12.170	0,01	USD 89.000	Chobani / Chobani Finance 7,5% 15/4/2025	88.872	0,05
USD 56.000	Camelot Return Merger Sub 8,75% 1/8/2028	55.519	0,03	USD 80.000	CHS/Community Health Systems 4,75% 15/2/2031	60.192	0,04
USD 15.000	Capital One Financial 2,359% 29/7/2032	10.742	0,01	USD 86.000	CHS/Community Health Systems 5,25% 15/5/2030	67.849	0,04
USD 85.000	Capital One Financial 2,618% 2/11/2032	64.821	0,04	USD 17.000	CHS/Community Health Systems 5,625% 15/3/2027	15.033	0,01
USD 25.000	Capital One Financial 5,817% 1/2/2034	23.770	0,01	USD 306.000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	256.621	0,15
USD 30.000	Capital One Financial 6,377% 8/6/2034	29.705	0,02	USD 10.000	Citigroup 1,122% 28/1/2027	8.956	0,01
USD 76.000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	74.918	0,05				
USD 207.000	Catalent Pharma Solutions 3,125% 15/2/2029	174.066	0,10				
USD 9.000	Catalent Pharma Solutions 3,5% 1/4/2030	7.575	0,00				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 97.000	Citigroup 2,572% 3/6/2031	80.170	0,05	USD 79.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	68.017	0,04
USD 42.000	Citigroup 2,666% 29/1/2031	35.213	0,02	USD 53.000	Covanta 5% 1/9/2030	45.040	0,03
USD 9.000	Citigroup 2,904% 3/11/2042	6.178	0,00	USD 51.000	Crocs 4,125% 15/8/2031	40.463	0,02
USD 38.000	Citigroup 2,976% 5/11/2030	32.643	0,02	USD 5.000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	4.289	0,00
USD 97.000	Citigroup 3,2% 21/10/2026	90.445	0,05	USD 192.000	Crown Americas / Crown Americas Capital V 4,25% 30/9/2026	181.154	0,11
USD 8.000	Citigroup 3,52% 27/10/2028	7.379	0,00	USD 16.000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4,75% 1/2/2026	15.445	0,01
USD 70.000	Citigroup 3,887% 10/1/2028	66.107	0,04	USD 15.000	Crown Castle 1,35% 15/7/2025	13.842	0,01
USD 16.000	Citigroup 4,3% 20/11/2026	15.363	0,01	USD 31.000	Crown Castle 2,25% 15/1/2031	24.913	0,02
USD 130.000	Citigroup 6,174% 25/5/2034	129.879	0,08	USD 65.000	Crown Castle 2,5% 15/7/2031	52.474	0,03
USD 70.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,25% 15/5/2026	69.365	0,04	USD 34.000	Crown Castle 2,9% 1/4/2041	22.959	0,01
USD 117.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,75% 15/5/2028	116.818	0,07	USD 14.000	Crown Castle 3,8% 15/2/2028	13.019	0,01
USD 301.000	Clarios Global / Clarios US Finance 8,5% 15/5/2027	304.591	0,18	USD 10.000	Crown Castle 4,3% 15/2/2029	9.392	0,01
USD 549.000	Clarivate Science 3,875% 1/7/2028	484.152	0,29	USD 200.000	CSC 4,125% 1/12/2030	142.798	0,09
USD 281.000	Clarivate Science 4,875% 1/7/2029	245.480	0,15	USD 200.000	CSC 4,5% 15/11/2031	142.564	0,09
USD 15.000	Clean Harbors 4,875% 15/7/2027	14.371	0,01	USD 15.000	CSX 4,1% 15/11/2032	14.088	0,01
USD 32.000	Clean Harbors 5,125% 15/7/2029	30.293	0,02	USD 31.000	CSX 4,3% 1/3/2048	26.162	0,02
USD 381.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	342.067	0,21	USD 4.000	CSX 4,5% 15/11/2052	3.490	0,00
USD 185.000	Clear Channel Outdoor 7,5% 1/6/2029	138.043	0,08	USD 235.000	Cushman & Wakefield US Borrower 6,75% 15/5/2028	222.417	0,13
USD 6.000	Clear Channel Outdoor 7,75% 15/4/2028	4.702	0,00	USD 40.000	Cushman & Wakefield US Borrower 8,875% 1/9/2031	40.445	0,02
USD 227.000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	228.112	0,14	USD 10.000	CVS Health 1,3% 21/8/2027	8.603	0,01
USD 4.000	Clearway Energy Operating 3,75% 15/2/2031	3.276	0,00	USD 10.000	CVS Health 4,3% 25/3/2028	9.609	0,01
USD 130.000	Clearway Energy Operating 3,75% 15/1/2032	106.207	0,06	USD 111.000	CVS Health 5% 20/2/2026	110.092	0,07
USD 944.000	Clearway Energy Operating 4,75% 15/3/2028	875.654	0,52	USD 41.000	CVS Health 5,05% 25/3/2048	36.003	0,02
USD 545.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	487.482	0,29	USD 25.000	CVS Health 5,125% 20/7/2045	22.275	0,01
USD 404.000	Cloud Software 9% 30/9/2029	361.318	0,22	USD 133.000	Darling Ingredients 5,25% 15/4/2027	129.503	0,08
USD 74.000	Clydesdale Acquisition 6,625% 15/4/2029	70.519	0,04	USD 322.000	Darling Ingredients 6% 15/6/2030	315.459	0,19
USD 62.000	Clydesdale Acquisition 8,75% 15/4/2030	56.097	0,03	USD 34.000	Dell International / EMC 6,02% 15/6/2026	34.348	0,02
USD 55.000	Comcast 1,95% 15/1/2031	44.495	0,03	USD 118.000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5,875% 15/8/2027	104.829	0,06
USD 25.000	Comcast 2,8% 15/1/2051	15.886	0,01	USD 248.000	Discover Financial Services 5,5% 30/10/2027	185.802	0,11
USD 30.000	Comcast 2,887% 1/11/2051	19.263	0,01	USD 84.000	Discovery Communications 3,95% 15/6/2025	81.184	0,05
USD 57.000	Comcast 2,937% 1/11/2056	35.527	0,02	USD 31.000	Dream Finders Homes 8,25% 15/8/2028	31.459	0,02
USD 25.000	Comcast 3,45% 1/2/2050	18.265	0,01	USD 314.000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029	280.650	0,17
USD 32.000	Comcast 3,75% 1/4/2040	26.349	0,02	USD 29.000	DuPont de Nemours 5,319% 15/11/2038	28.383	0,02
USD 35.000	Comcast 3,9% 1/3/2038	29.835	0,02	USD 8.000	DuPont de Nemours 5,419% 15/11/2048	7.760	0,00
USD 25.000	Comcast 4% 15/8/2047	20.116	0,01	USD 95.000	Dycom Industries 4,5% 15/4/2029	84.979	0,05
USD 25.000	Comcast 4,7% 15/10/2048	22.649	0,01	USD 45.000	Ecolab 2,7% 15/12/2051	28.549	0,02
USD 5.000	Comcast 4,95% 15/10/2058	4.618	0,00	USD 489.000	Element Solutions 3,875% 1/9/2028	430.034	0,26
USD 125.000	Commonwealth Edison 3,85% 15/3/2052	95.441	0,06	USD 10.000	Elevance Health 2,25% 15/5/2030	8.347	0,00
USD 121.000	CommScope 6% 1/3/2026	109.727	0,07	USD 1.000	Elevance Health 2,375% 15/1/2025	957	0,00
USD 51.000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	46.669	0,03	USD 5.000	Elevance Health 3,125% 15/5/2050	3.392	0,00
USD 49.000	Compass Diversified 5,25% 15/4/2029	45.037	0,03	USD 18.000	Elevance Health 3,7% 15/9/2049	13.449	0,01
USD 119.000	Consensus Cloud Solutions 6% 15/10/2026	110.918	0,07	USD 25.000	Elevance Health 4,65% 15/1/2043	22.244	0,01
USD 9.000	Consensus Cloud Solutions 6,5% 15/10/2028	8.101	0,00	USD 30.000	Elevance Health 4,75% 15/2/2033	29.069	0,02
USD 135.000	CoreLogic 4,5% 1/5/2028	110.484	0,07				
USD 83.000	Coty/HFC Prestige Products/ HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030	82.768	0,05				

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 20.000	Elevance Health 5,5% 15/10/2032	20.400	0,01	USD 70.000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	60.003	0,04
USD 5.000	Elevance Health 6,1% 15/10/2052	5.323	0,00	USD 192.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	174.962	0,10
USD 12.000	Elevance Health 6,375% 15/6/2037	12.724	0,01	USD 249.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	241.729	0,14
USD 25.000	Embeckta 6,75% 15/2/2030	22.060	0,01	USD 100.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	106.648	0,06
USD 498.000	Emerald Debt Merger Sub 6,625% 15/12/2030	490.063	0,29	USD 6.000	Gartner 4,5% 1/7/2028	5.603	0,00
USD 181.000	Encompass Health 4,5% 1/2/2028	168.614	0,10	USD 19.000	GCI 4,75% 15/10/2028	16.504	0,01
USD 91.000	Encompass Health 4,625% 1/4/2031	79.774	0,05	USD 137.000	Gen Digital 6,75% 30/9/2027	137.073	0,08
USD 2.000	Encompass Health 4,75% 1/2/2030	1.826	0,00	USD 7.000	General Electric 8,882% 15/9/2023	7.016	0,00
USD 15.000	EnPro Industries 5,75% 15/10/2026	14.641	0,01	USD 60.000	General Mills 4% 17/4/2025	58.461	0,03
USD 33.000	Entegris 4,375% 15/4/2028	30.266	0,02	USD 58.000	General Mills 4,95% 29/3/2033	56.556	0,03
USD 531.000	Entegris Escrow 4,75% 15/4/2029	493.510	0,30	USD 38.000	General Motors 5,4% 1/4/2048	31.770	0,02
USD 40.000	Equinix 1,55% 15/3/2028	33.764	0,02	USD 50.000	General Motors 5,6% 15/10/2032	48.110	0,03
USD 101.000	Equinix 2,9% 18/11/2026	93.300	0,06	USD 14.000	General Motors 6,6% 1/4/2036	14.117	0,01
USD 24.000	Equinix 3% 15/7/2050	15.199	0,01	USD 125.000	General Motors Financial 2,9% 26/2/2025	119.356	0,07
USD 6.000	Equinix 3,2% 18/11/2029	5.251	0,00	USD 41.000	General Motors Financial 4,35% 17/1/2027	39.009	0,02
USD 245.000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	224.210	0,13	USD 15.000	General Motors Financial 6% 9/1/2028	15.034	0,01
USD 1.100.308	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2052	1.055.976	0,63	USD 55.000	Gilead Sciences 2,8% 1/10/2050	35.539	0,02
USD 676.299	Fannie Mae Pool 4,5% 1/10/2052	641.633	0,38	USD 20.000	Gilead Sciences 4,15% 1/3/2047	16.760	0,01
USD 102.021	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2052	99.160	0,06	USD 18.000	Gilead Sciences 4,5% 1/2/2045	15.834	0,01
USD 424.410	Fannie Mae Pool 6% 1/2/2053	426.195	0,26	USD 36.000	Gilead Sciences 4,75% 1/3/2046	32.795	0,02
USD 71.000	FedEx 3,1% 5/8/2029	63.565	0,04	USD 4.993.909	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/1/2052	4.148.243	2,48
USD 14.000	FedEx 4,55% 1/4/2046	11.753	0,01	USD 4.021.961	Ginnie Mae II Pool 3% 20/7/2051	3.461.884	2,07
USD 8.000	FedEx 5,25% 15/5/2050	7.453	0,00	USD 18.692	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/1/2041	17.197	0,01
USD 8.000	Fidelity National Information Services 1,15% 1/3/2026	7.199	0,00	USD 40.369	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2042	37.140	0,02
USD 21.000	Fidelity National Information Services 4,7% 15/7/2027	20.566	0,01	USD 69.997	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2042	64.398	0,04
USD 6.000	Fidelity National Information Services 5,625% 15/7/2052	5.700	0,00	USD 258.693	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/8/2042	238.002	0,14
USD 20.000	Fifth Third Bancorp 6,339% 27/7/2029	20.229	0,01	USD 734.533	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2043	675.781	0,41
USD 60.000	FirstEnergy Transmission 4,35% 15/1/2025	58.413	0,04	USD 170.089	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2044	156.484	0,09
USD 2.000	Fiserv 2,65% 1/6/2030	1.687	0,00	USD 79.914	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	73.030	0,04
USD 60.000	Fiserv 2,75% 1/7/2024	58.492	0,04	USD 577.898	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/11/2051	513.923	0,31
USD 98.000	Fiserv 3,8% 1/10/2023	97.842	0,06	USD 72.184	Ginnie Mae II Pool 4% 20/12/2041	67.787	0,04
USD 6.000	Fiserv 3,85% 1/6/2025	5.823	0,00	USD 68.839	Ginnie Mae II Pool 4% 20/8/2044	64.496	0,04
USD 15.000	Fiserv 4,4% 1/7/2049	12.286	0,01	USD 521.153	Ginnie Mae II Pool 4% 20/9/2047	479.380	0,29
USD 184.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032	143.909	0,09	USD 6.000	Global Payments 4,8% 1/4/2026	5.865	0,00
USD 102.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	97.353	0,06	USD 70.000	Global Payments 5,3% 15/8/2029	68.261	0,04
USD 200.000	Ford Motor Credit 2,7% 10/8/2026	179.339	0,11	USD 17.000	Global Payments 5,4% 15/8/2032	16.644	0,01
USD 200.000	Ford Motor Credit 4,389% 8/1/2026	189.592	0,11	USD 20.000	Global Payments 5,95% 15/8/2052	19.122	0,01
USD 267.000	Ford Motor Credit 5,125% 16/6/2025	260.075	0,16	USD 177.000	Go Daddy Operating / GD Finance 3,5% 1/3/2029	152.477	0,09
USD 408.000	Ford Motor Credit 6,8% 12/5/2028	408.092	0,24				
USD 200.000	Ford Motor Credit 7,35% 6/3/2030	203.797	0,12				
USD 48.000	Fortrea 7,5% 1/7/2030	47.424	0,03				
USD 2.112.961	Freddie Mac Pool 5% 1/8/2052	2.056.022	1,23				
USD 45.000	Freeport-McMoRan 5,4% 14/11/2034	42.665	0,03				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 41.000	Go Daddy Operating / GD Finance 5,25% 1/12/2027	39.193	0,02	USD 63.000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	54.636	0,03
USD 52.000	Goldman Sachs 1,431% 9/3/2027	46.618	0,03	USD 279.000	Hilton Domestic Operating 4,875% 15/1/2030	260.443	0,16
USD 6.000	Goldman Sachs 2,383% 21/7/2032	4.744	0,00	USD 10.000	Hilton Domestic Operating 5,375% 1/5/2025	9.939	0,01
USD 15.000	Goldman Sachs 2,6% 7/2/2030	12.666	0,01	USD 61.000	Hilton Domestic Operating 5,75% 1/5/2028	59.902	0,04
USD 79.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	63.987	0,04	USD 55.000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4,875% 1/4/2027	53.119	0,03
USD 90.000	Goldman Sachs 2,65% 21/10/2032	72.265	0,04	USD 234.000	Hologic 3,25% 15/2/2029	203.876	0,12
USD 75.000	Goldman Sachs 3% 15/3/2024	73.860	0,04	USD 56.000	Home Depot 3,35% 15/4/2050	41.094	0,02
USD 57.000	Goldman Sachs 3,615% 15/3/2028	53.300	0,03	USD 8.000	Home Depot 3,9% 15/6/2047	6.524	0,00
USD 4.000	Goldman Sachs 3,75% 25/2/2026	3.836	0,00	USD 5.000	Home Depot 4,5% 6/12/2048	4.477	0,00
USD 34.000	Goldman Sachs 4,223% 1/5/2029	32.008	0,02	USD 24.000	Home Depot 4,95% 15/9/2052	22.989	0,01
USD 100.000	Goldman Sachs 5,7% 1/11/2024	99.822	0,06	USD 186.000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	174.393	0,10
USD 3.000	Goodyear Tire & Rubber 5,625% 30/4/2033	2.578	0,00	USD 64.000	Howard Hughes 4,125% 1/2/2029	52.703	0,03
USD 160.000	Goodyear Tire & Rubber 9,5% 31/5/2025	163.592	0,10	USD 153.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	138.171	0,08
USD 418.535	Government National Mortgage Association 2,5% 20/10/2051	57.602	0,04	USD 115.000	HP 2,2% 17/6/2025	108.324	0,07
USD 120.000	Graphic Packaging International 3,5% 15/3/2028	107.076	0,06	USD 18.000	HP 3% 17/6/2027	16.549	0,01
USD 3.000	Graphic Packaging International 4,75% 15/7/2027	2.853	0,00	USD 36.000	HP 4,75% 15/1/2028	35.070	0,02
USD 26.000	Gray Television 5,875% 15/7/2026	23.818	0,01	USD 152.000	HUB International 7% 1/5/2026	151.897	0,09
USD 16.000	Gray Television 7% 15/5/2027	14.382	0,01	USD 417.000	HUB International 7,25% 15/6/2030	422.651	0,25
USD 154.000	GYP III 4,625% 1/5/2029	135.612	0,08	USD 14.000	Hughes Satellite Systems 5,25% 1/8/2026	12.782	0,01
USD 4.000	H&E Equipment Services 3,875% 15/12/2028	3.502	0,00	USD 5.000	Humana 2,15% 3/2/2032	3.924	0,00
USD 20.000	Hanesbrands 4,875% 15/5/2026	18.731	0,01	USD 236.000	ILFC E-Capital Trust I 7,064% 21/12/2065	171.311	0,10
USD 186.000	Hanesbrands 9% 15/2/2031	186.829	0,11	USD 157.000	ILFC E-Capital Trust II 7,314% 21/12/2065	115.199	0,07
USD 212.000	HAT I / HAT II 3,375% 15/6/2026	190.414	0,11	USD 19.000	Installed Building Products 5,75% 1/2/2028	17.860	0,01
USD 82.000	HB Fuller 4% 15/2/2027	76.442	0,05	USD 17.000	Intel 2,8% 12/8/2041	11.822	0,01
USD 64.000	HB Fuller 4,25% 15/10/2028	57.188	0,03	USD 2.000	Intel 3,1% 15/2/2060	1.246	0,00
USD 3.000	HCA 3,5% 1/9/2030	2.622	0,00	USD 2.000	Intel 3,2% 12/8/2061	1.256	0,00
USD 28.000	HCA 3,5% 15/7/2051	18.689	0,01	USD 15.000	Intel 5,625% 10/2/2043	14.939	0,01
USD 30.000	HCA 3,625% 15/3/2032	25.801	0,02	USD 50.000	Intel 5,7% 10/2/2053	49.626	0,03
USD 57.000	HCA 4,625% 15/3/2052	45.806	0,03	USD 27.000	Intel 5,9% 10/2/2063	27.136	0,02
USD 69.000	HCA 5% 15/3/2024	68.628	0,04	USD 4.000	Intercontinental Exchange 3,1% 15/9/2027	3.701	0,00
USD 9.000	HCA 5,25% 15/6/2049	7.883	0,00	USD 90.000	Intercontinental Exchange 3,75% 21/9/2028	84.885	0,05
USD 36.000	HCA 5,375% 1/9/2026	35.710	0,02	USD 3.000	Intercontinental Exchange 4,25% 21/9/2048	2.524	0,00
USD 15.000	HCA 5,9% 1/6/2053	14.440	0,01	USD 28.000	Intercontinental Exchange 4,6% 15/3/2033	26.802	0,02
USD 323.000	HealthEquity 4,5% 1/10/2029	286.666	0,17	USD 23.000	International Business Machines 4% 20/6/2042	18.957	0,01
USD 27.000	Healthpeak 3,5% 15/7/2029	24.237	0,01	USD 15.000	Interpublic of 3,375% 1/3/2041	10.585	0,01
USD 30.000	Healthpeak 5,25% 15/12/2032	28.971	0,02	USD 4.000	Interpublic of 4,75% 30/3/2030	3.814	0,00
USD 210.000	Herc 5,5% 15/7/2027	202.270	0,12	USD 55.000	Invitation Homes Operating Partnership 5,5% 15/8/2033	53.283	0,03
USD 19.000	Hertz 4,625% 1/12/2026	17.153	0,01	USD 200.000	IQVIA 5% 15/5/2027	192.299	0,12
USD 56.000	Hertz 5% 1/12/2029	46.076	0,03	USD 69.000	Iron Mountain 5,625% 15/7/2032	61.995	0,04
USD 8.000	Hewlett Packard Enterprise 4,45% 2/10/2023	7.991	0,00	USD 198.000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	197.872	0,12
USD 40.000	Hewlett Packard Enterprise 5,9% 1/10/2024	40.056	0,02	USD 67.000	Iron Mountain Information Management Services 5% 15/7/2032	57.964	0,04
USD 11.000	Hilton Domestic Operating 3,625% 15/2/2032	9.149	0,01	USD 4.000	Johnson & Johnson 2,9% 15/1/2028	3.745	0,00
USD 163.000	Hilton Domestic Operating 3,75% 1/5/2029	143.873	0,09	USD 39.000	JPMorgan Chase 1,47% 22/9/2027	34.465	0,02

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 111.000	JPMorgan Chase 2,182% 1/6/2028	98.552	0,06	USD 163.000	Level 3 Financing 4,625% 15/9/2027	122.786	0,07
USD 60.000	JPMorgan Chase 2,525% 19/11/2041	40.336	0,02	USD 218.000	Level 3 Financing 10,5% 15/5/2030	221.566	0,13
USD 30.000	JPMorgan Chase 2,963% 25/1/2033	24.949	0,02	USD 305.000	Levi Strauss 3,5% 1/3/2031	247.382	0,15
USD 101.000	JPMorgan Chase 3,157% 22/4/2042	74.405	0,04	USD 78.000	LifePoint Health 9,875% 15/8/2030	76.994	0,05
USD 140.000	JPMorgan Chase 3,22% 1/3/2025	138.060	0,08	USD 120.000	Lindblad Expeditions 6,75% 15/2/2027	116.353	0,07
USD 14.000	JPMorgan Chase 3,625% 1/12/2027	13.160	0,01	USD 60.000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	61.708	0,04
USD 36.000	JPMorgan Chase 3,882% 24/7/2038	30.355	0,02	USD 71.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	42.973	0,03
USD 119.000	JPMorgan Chase 4,005% 23/4/2029	111.539	0,07	USD 96.000	Lithia Motors 3,875% 1/6/2029	82.527	0,05
USD 10.000	JPMorgan Chase 4,125% 15/12/2026	9.619	0,01	USD 96.000	Live Nation Entertainment 3,75% 15/1/2028	85.714	0,05
USD 20.000	JPMorgan Chase 4,95% 1/6/2045	18.397	0,01	USD 145.000	Live Nation Entertainment 4,75% 15/10/2027	134.681	0,08
USD 75.000	JPMorgan Chase 5,299% 24/7/2029	74.559	0,04	USD 3.000	Live Nation Entertainment 4,875% 1/11/2024	2.949	0,00
USD 2.000	JPMorgan Chase 5,625% 16/8/2043	1.993	0,00	USD 4.000	Live Nation Entertainment 5,625% 15/3/2026	3.883	0,00
USD 724.000	JPMorgan Chase 6,626% 15/5/2047	618.180	0,37	USD 192.000	Live Nation Entertainment 6,5% 15/5/2027	192.268	0,12
USD 18.000	KB Home 7,25% 15/7/2030	18.154	0,01	USD 54.000	Lowe's 3% 15/10/2050	34.330	0,02
USD 23.000	Keurig Dr Pepper 4,5% 15/4/2052	19.569	0,01	USD 3.000	Lowe's 3,5% 1/4/2051	2.066	0,00
USD 10.000	Kilroy Realty 3,05% 15/2/2030	7.992	0,01	USD 13.000	Lowe's 3,65% 5/4/2029	12.063	0,01
USD 44.000	Kimco Realty 4,6% 1/2/2033	40.465	0,02	USD 27.000	Lowe's 3,7% 15/4/2046	20.232	0,01
USD 31.000	KLA 3,3% 1/3/2050	22.377	0,01	USD 30.000	Lowe's 4,25% 1/4/2052	23.776	0,01
USD 49.000	KLA 4,1% 15/3/2029	47.054	0,03	USD 15.000	Lowe's 4,45% 1/4/2062	11.701	0,01
USD 20.000	KLA 4,65% 15/7/2032	19.640	0,01	USD 5.000	Lowe's 4,65% 15/4/2042	4.374	0,00
USD 35.000	Kobe US Midco 2 9,25% 1/11/2026	25.594	0,01	USD 60.000	Lowe's 5% 15/4/2033	58.630	0,04
USD 74.000	Kontoor Brands 4,125% 15/11/2029	62.843	0,04	USD 15.000	Lowe's 5,5% 15/10/2035	15.145	0,01
USD 140.000	Korn Ferry 4,625% 15/12/2027	130.346	0,08	USD 10.000	Lowe's 5,625% 15/4/2053	9.739	0,01
USD 40.000	Kraft Heinz Foods 3% 1/6/2026	37.679	0,02	USD 78.000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	48.824	0,03
USD 9.000	Kraft Heinz Foods 4,375% 1/6/2046	7.456	0,00	USD 104.000	Madison IAQ 5,875% 30/6/2029	87.617	0,05
USD 114.000	Kraft Heinz Foods 4,875% 1/10/2049	101.211	0,06	USD 4.000	Marsh & McLennan 2,25% 15/11/2030	3.308	0,00
USD 18.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,25% 1/2/2027	16.298	0,01	USD 4.000	Marsh & McLennan 2,375% 15/12/2031	3.257	0,00
USD 6.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,75% 15/6/2029	5.049	0,00	USD 45.000	Marsh & McLennan 4,375% 15/3/2029	43.510	0,03
USD 7.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5,25% 1/10/2025	6.745	0,00	USD 21.000	Mastercard 3,35% 26/3/2030	19.315	0,01
USD 37.000	Lam Research 2,875% 15/6/2050	24.788	0,01	USD 29.000	Mastercard 3,85% 26/3/2050	24.130	0,01
USD 100.000	Lamb Weston 4,125% 31/1/2030	88.167	0,05	USD 111.000	Match II 3,625% 1/10/2031	90.287	0,05
USD 220.000	Lamb Weston 4,375% 31/1/2032	190.564	0,11	USD 53.000	Match II 4,125% 1/8/2030	45.509	0,03
USD 261.000	Lamb Weston 4,875% 15/5/2028	246.877	0,15	USD 121.000	Match II 4,625% 1/6/2028	111.591	0,07
USD 13.000	Legacy LifePoint Health 4,375% 15/2/2027	11.245	0,01	USD 8.000	Match II 5,625% 15/2/2029	7.550	0,00
USD 132.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	120.854	0,07	USD 37.000	Mattel 5,45% 1/11/2041	31.898	0,02
USD 16.000	Level 3 Financing 3,625% 15/1/2029	9.540	0,01	USD 30.000	Mattel 6,2% 1/10/2040	28.053	0,02
				USD 418.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	411.158	0,25
				USD 14.000	Mauser Packaging Solutions 9,25% 15/4/2027	12.712	0,01
				USD 378.000	McAfee 7,375% 15/2/2030	331.121	0,20
				USD 49.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	42.702	0,03
				USD 181.000	Medline Borrower 5,25% 1/10/2029	161.174	0,10
				USD 150.000	Mercedes-Benz Finance North America 5,5% 27/11/2024	149.758	0,09
				USD 32.000	Merck 1,45% 24/6/2030	25.827	0,02
				USD 20.000	Merck 2,15% 10/12/2031	16.347	0,01
				USD 18.000	Merck 2,75% 10/12/2051	11.801	0,01
				USD 20.000	Merck 4% 7/3/2049	16.973	0,01
				USD 15.000	Merck 4,5% 17/5/2033	14.625	0,01

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 10.000	Merck 5% 17/5/2053	9.776	0,01	USD 25.000	NESCO II 5,5% 15/4/2029	22.725	0,01
USD 10.000	Merck 6,5% 1/12/2033	11.211	0,01	USD 25.000	Newmont 2,8% 1/10/2029	21.547	0,01
USD 23.000	Meritage Homes 5,125% 6/6/2027	22.119	0,01	USD 4.000	Newmont 5,45% 9/6/2044	3.810	0,00
USD 172.000	MetLife 3,85% 15/9/2025	159.031	0,10	USD 312.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/7/2024	306.432	0,18
USD 10.000	MetLife 5% 15/7/2052	9.162	0,01	USD 114.000	NFP 4,875% 15/8/2028	101.883	0,06
USD 92.000	MGIC Investment 5,25% 15/8/2028	87.808	0,05	USD 255.000	NFP 6,875% 15/8/2028	224.702	0,13
USD 83.000	Microsoft 2,525% 1/6/2050	55.043	0,03	USD 28.000	NFP 7,5% 1/10/2030	27.242	0,02
USD 27.000	Microsoft 2,921% 17/3/2052	19.189	0,01	USD 20.000	Norfolk Southern 3,05% 15/5/2050	13.374	0,01
USD 62.000	Microsoft 3,45% 8/8/2036	55.164	0,03	USD 4.000	Norfolk Southern 3,4% 1/11/2049	2.839	0,00
USD 131.000	MicroStrategy 6,125% 15/6/2028	117.359	0,07	USD 20.000	Norfolk Southern 3,7% 15/3/2053	14.899	0,01
USD 126.883	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6,5% 20/6/2027	126.536	0,08	USD 28.000	Norfolk Southern 3,8% 1/8/2028	26.387	0,02
USD 76.000	ModivCare 5,875% 15/11/2025	72.189	0,04	USD 25.000	Norfolk Southern 4,15% 28/2/2048	20.573	0,01
USD 32.000	Molina Healthcare 3,875% 15/11/2030	27.370	0,02	USD 37.000	Norfolk Southern 4,45% 1/3/2033	35.067	0,02
USD 8.000	Molina Healthcare 3,875% 15/5/2032	6.637	0,00	USD 16.000	Norfolk Southern 4,55% 1/6/2053	13.872	0,01
USD 102.000	Molina Healthcare 4,375% 15/6/2028	93.923	0,06	USD 25.000	Norfolk Southern 5,05% 1/8/2030	24.729	0,01
USD 170.000	Morgan Stanley 1,512% 20/7/2027	150.847	0,09	USD 15.000	Norfolk Southern 5,35% 1/8/2054	14.601	0,01
USD 133.000	Morgan Stanley 1,593% 4/5/2027	119.330	0,07	USD 16.000	Northern Trust 3,15% 3/5/2029	14.571	0,01
USD 66.000	Morgan Stanley 2,699% 22/1/2031	55.558	0,03	USD 16.000	Northern Trust 3,95% 30/10/2025	15.480	0,01
USD 15.000	Morgan Stanley 2,802% 25/1/2052	9.529	0,01	USD 64.000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4,75% 30/4/2027	55.861	0,03
USD 4.000	Morgan Stanley 3,217% 22/4/2042	2.956	0,00	USD 557.000	Novelis 3,25% 15/11/2026	505.531	0,30
USD 30.000	Morgan Stanley 3,591% 22/7/2028	27.748	0,02	USD 415.000	Novelis 3,875% 15/8/2031	344.057	0,21
USD 12.000	Morgan Stanley 3,622% 1/4/2031	10.666	0,01	USD 72.000	Novelis 4,75% 30/1/2030	64.599	0,04
USD 51.000	Morgan Stanley 3,772% 24/1/2029	47.270	0,03	USD 50.000	NRG Energy 7% 15/3/2033	49.399	0,03
USD 150.000	Morgan Stanley 4,21% 20/4/2028	143.398	0,09	USD 3.000	Nucor 2% 1/6/2025	2.822	0,00
USD 26.000	Morgan Stanley 5% 24/11/2025	25.592	0,02	USD 50.000	Nucor 3,95% 23/5/2025	48.616	0,03
USD 10.000	Morgan Stanley 5,123% 1/2/2029	9.795	0,01	USD 34.000	NVIDIA 3,5% 1/4/2040	28.317	0,02
USD 70.000	Morgan Stanley 5,164% 20/4/2029	68.619	0,04	USD 12.000	Ohio Power 2,6% 1/4/2030	10.172	0,01
USD 20.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	19.861	0,01	USD 42.000	Ohio Power 2,9% 1/10/2051	26.809	0,02
USD 49.000	Motorola Solutions 2,75% 24/5/2031	39.761	0,02	USD 25.000	Ohio Power 4% 1/6/2049	19.631	0,01
USD 43.000	Motorola Solutions 4,6% 23/5/2029	41.359	0,02	USD 25.000	Ohio Power 4,15% 1/4/2048	20.095	0,01
USD 53.000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	46.820	0,03	USD 25.000	Ohio Power 5% 1/6/2033	24.371	0,01
USD 30.000	Nasdaq 5,55% 15/2/2034	29.919	0,02	USD 50.000	Oncor Electric Delivery 2,7% 15/11/2051	30.821	0,02
USD 17.000	Nationstar Mortgage 5,75% 15/11/2031	14.596	0,01	USD 17.000	Oncor Electric Delivery 3,75% 1/4/2045	13.415	0,01
USD 48.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	45.764	0,03	USD 10.000	Oncor Electric Delivery 3,8% 1/6/2049	7.760	0,00
USD 32.000	Navient 5,5% 15/3/2029	27.392	0,02	USD 25.000	Oncor Electric Delivery 4,3% 15/5/2028	24.221	0,01
USD 20.000	Navient 6,125% 25/3/2024	19.921	0,01	USD 43.000	Oncor Electric Delivery 4,95% 15/9/2052	39.918	0,02
USD 37.000	Navient 9,375% 25/7/2030	37.107	0,02	USD 25.000	Oncor Electric Delivery 5,25% 30/9/2040	24.648	0,02
USD 11.000	NCR 5% 1/10/2028	10.102	0,01	USD 26.000	OneMain Finance 3,5% 15/1/2027	22.550	0,01
USD 35.000	NCR 5,125% 15/4/2029	31.831	0,02	USD 95.000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	74.082	0,04
USD 9.000	NCR 5,75% 1/9/2027	9.097	0,01	USD 9.000	OneMain Finance 5,375% 15/11/2029	7.829	0,01
USD 20.000	NCR 6,125% 1/9/2029	20.594	0,01	USD 74.000	OneMain Finance 6,875% 15/3/2025	73.708	0,04
USD 20.000	Neptune Bidco US 9,29% 15/4/2029	18.648	0,01	USD 158.000	OneMain Finance 7,125% 15/3/2026	155.741	0,09
				USD 23.000	OneMain Finance 9% 15/1/2029	23.326	0,01

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 122.000	Option Care Health 4,375% 31/10/2029	107.467	0,06	USD 16.000	Prologis 2,875% 15/11/2029	14.010	0,01
USD 131.000	Oracle 2,95% 1/4/2030	113.488	0,07	USD 12.000	Prologis 3,05% 1/3/2050	8.001	0,01
USD 3.000	Oracle 3,6% 1/4/2050	2.079	0,00	USD 55.000	Prologis 5,125% 15/1/2034	54.159	0,03
USD 20.000	Oracle 3,65% 25/3/2041	15.143	0,01	USD 4.000	Prudential Financial 2,1% 10/3/2030	3.357	0,00
USD 14.000	Oracle 3,85% 15/7/2036	11.606	0,01	USD 4.000	Prudential Financial 4,6% 15/5/2044	3.537	0,00
USD 24.000	Oracle 3,85% 1/4/2060	16.376	0,01	USD 115.000	PTC 3,625% 15/2/2025	111.233	0,07
USD 91.000	Oracle 3,95% 25/3/2051	66.484	0,04	USD 23.000	PTC 4% 15/2/2028	21.103	0,01
USD 12.000	Oracle 4% 15/11/2047	8.976	0,01	USD 135.000	Public Service Electric and Gas 3,1% 15/3/2032	117.190	0,07
USD 36.000	Oracle 4,125% 15/5/2045	27.870	0,02	USD 85.000	Public Service Electric and Gas 4,65% 15/3/2033	82.428	0,05
USD 49.000	Oracle 5,375% 15/7/2040	45.842	0,03	USD 10.000	Public Service Electric and Gas 5,125% 15/3/2053	9.779	0,01
USD 10.000	Oracle 5,55% 6/2/2053	9.325	0,01	USD 15.000	QUALCOMM 4,3% 20/5/2047	13.012	0,01
USD 200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4,125% 30/4/2028	181.043	0,11	USD 15.000	QUALCOMM 4,8% 20/5/2045	14.154	0,01
USD 200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5,125% 30/4/2031	170.582	0,10	USD 10.000	QUALCOMM 6% 20/5/2053	10.789	0,01
USD 15.000	Otis Worldwide 5,25% 16/8/2028	15.093	0,01	USD 57.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4,5% 15/9/2026	44.528	0,03
USD 149.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,25% 15/1/2029	122.369	0,07	USD 70.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6,5% 15/9/2028	37.878	0,02
USD 6.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	4.883	0,00	USD 7.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,75% 15/1/2029	5.074	0,00
USD 153.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	138.626	0,08	USD 4.000	Realty Income 2,85% 15/12/2032	3.242	0,00
USD 67.000	Owens-Brockway Glass Container 6,625% 13/5/2027	66.381	0,04	USD 19.000	Realty Income 3% 15/1/2027	17.666	0,01
USD 212.000	Owens-Brockway Glass Container 7,25% 15/5/2031	213.155	0,13	USD 16.000	Realty Income 3,65% 15/1/2028	14.962	0,01
USD 40.000	PacifiCorp 5,35% 1/12/2053	34.592	0,02	USD 22.000	Realty Income 3,95% 15/8/2027	20.976	0,01
USD 83.000	Paramount Global 6,375% 30/3/2062	68.653	0,04	USD 15.000	Realty Income 4,85% 15/3/2030	14.522	0,01
USD 25.000	Parker-Hannifin 4,5% 15/9/2029	24.147	0,01	USD 40.000	Realty Income 5,625% 13/10/2032	39.986	0,02
USD 82.000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4,5% 15/8/2028	74.876	0,05	USD 268.000	Regal Rexnord 6,05% 15/4/2028	265.308	0,16
USD 27.000	PayPal 1,65% 1/6/2025	25.295	0,02	USD 30.000	Regency Centers 2,95% 15/9/2029	25.909	0,02
USD 8.000	PayPal 3,25% 1/6/2050	5.695	0,00	USD 18.000	Regency Centers 3,6% 1/2/2027	16.969	0,01
USD 15.000	PayPal 4,4% 1/6/2032	14.346	0,01	USD 85.000	Regency Centers 3,7% 15/6/2030	76.278	0,05
USD 225.000	Pediatrix Medical 5,375% 15/2/2030	204.959	0,12	USD 14.000	RegionalCare Hospital Partners / LifePoint Health 9,75% 1/12/2026	13.059	0,01
USD 20.000	Penske Automotive 3,5% 1/9/2025	19.103	0,01	USD 12.000	Republic Services 2,3% 1/3/2030	10.172	0,01
USD 15.000	PepsiCo 3,9% 18/7/2032	14.225	0,01	USD 27.000	Republic Services 2,375% 15/3/2033	21.476	0,01
USD 14.000	Pfizer 2,625% 1/4/2030	12.316	0,01	USD 20.000	Republic Services 4,875% 1/4/2029	19.709	0,01
USD 22.000	Pfizer 3,45% 15/3/2029	20.617	0,01	USD 8.000	Resideo Funding 4% 1/9/2029	6.698	0,00
USD 67.000	Pfizer 4% 15/12/2036	60.847	0,04	USD 19.000	Ritchie Bros 6,75% 15/3/2028	19.153	0,01
USD 266.000	PNC Financial Services 3,4% 15/9/2026	202.174	0,12	USD 64.000	Ritchie Bros 7,75% 15/3/2031	65.924	0,04
USD 350.000	PNC Financial Services 9,312% 1/11/2023	352.365	0,21	USD 16.000	RLJ Lodging Trust 3,75% 1/7/2026	14.674	0,01
USD 8.000	Presidio 4,875% 1/2/2027	7.482	0,00	USD 14.000	RLJ Lodging Trust 4% 15/9/2029	11.724	0,01
USD 16.000	Prestige Brands 3,75% 1/4/2031	13.254	0,01	USD 216.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	192.186	0,12
USD 222.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5,75% 15/4/2026	218.144	0,13	USD 16.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,875% 1/3/2031	12.979	0,01
USD 97.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6,25% 15/1/2028	92.760	0,06	USD 18.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 4% 15/10/2033	14.235	0,01
USD 10.000	Progressive 3% 15/3/2032	8.696	0,01	USD 14.000	Ryder System 2,5% 1/9/2024	13.531	0,01
USD 3.000	Progressive 3,7% 15/3/2052	2.300	0,00				
USD 8.000	Progressive 6,25% 1/12/2032	8.595	0,01				
USD 29.000	Prologis 2,25% 15/4/2030	24.369	0,01				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 40.000	Ryder System 2,85% 1/3/2027	36.796	0,02	USD 2.000	Steel Dynamics 2,4% 15/6/2025	1.883	0,00
USD 55.000	Ryder System 3,65% 18/3/2024	54.336	0,03	USD 21.000	Steel Dynamics 3,25% 15/10/2050	13.574	0,01
USD 52.000	Ryder System 5,65% 1/3/2028	52.103	0,03	USD 32.000	Stericycle 3,875% 15/1/2029	27.948	0,02
USD 30.000	S&P Global 2,7% 1/3/2029	26.831	0,02	USD 44.000	Surgery Center 6,75% 1/7/2025	44.002	0,03
USD 10.000	S&P Global 2,9% 1/3/2032	8.580	0,01	USD 111.000	Surgery Center 10% 15/4/2027	113.048	0,07
USD 5.000	S&P Global 3,25% 1/12/2049	3.596	0,00	USD 39.000	SWF Escrow Issuer 6,5% 1/10/2029	25.166	0,02
USD 129.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	126.925	0,08	USD 125.000	Synaptics 4% 15/6/2029	105.965	0,06
USD 5.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	4.931	0,00	USD 4.000	Taylor Morrison Communities 5,125% 1/8/2030	3.675	0,00
USD 31.000	Salesforce 2,7% 15/7/2041	22.121	0,01	USD 102.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	100.322	0,06
USD 20.000	Salesforce 2,9% 15/7/2051	13.425	0,01	USD 31.000	TEGNA 4,75% 15/3/2026	29.563	0,02
USD 238.000	SBA Communications 3,125% 1/2/2029	203.613	0,12	USD 169.000	Teleflex 4,25% 1/6/2028	155.618	0,09
USD 242.000	SBA Communications 3,875% 15/2/2027	224.075	0,13	USD 91.000	Teleflex 4,625% 15/11/2027	85.433	0,05
USD 179.000	Sealed Air 4% 1/12/2027	163.490	0,10	USD 11.000	Tempo Acquisition / Tempo Acquisition Finance 5,75% 1/6/2025	10.824	0,01
USD 10.000	Sealed Air 5% 15/4/2029	9.272	0,01	USD 3.000	Tempur Sealy International 3,875% 15/10/2031	2.415	0,00
USD 48.000	Sealed Air/Sealed Air US 6,125% 1/2/2028	47.404	0,03	USD 81.000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	69.862	0,04
USD 300.000	Sensata Technologies 4,375% 15/2/2030	265.554	0,16	USD 6.000	Tenet Healthcare 4,625% 15/6/2028	5.530	0,00
USD 35.000	Sherwin-Williams 2,3% 15/5/2030	29.252	0,02	USD 111.000	Tenet Healthcare 4,875% 1/1/2026	107.687	0,06
USD 155.000	Sherwin-Williams 3,125% 1/6/2024	152.142	0,09	USD 28.000	Tenet Healthcare 5,125% 1/11/2027	26.693	0,02
USD 10.000	Sherwin-Williams 3,3% 15/5/2050	6.801	0,00	USD 148.000	Tenet Healthcare 6,125% 1/10/2028	142.622	0,09
USD 43.000	Shift4 Payments 0% 15/12/2025	42.863	0,03	USD 137.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	132.856	0,08
USD 203.000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4,625% 1/11/2026	189.992	0,11	USD 74.000	Tenet Healthcare 6,25% 1/2/2027	72.998	0,04
USD 62.000	Simon Property 5,5% 8/3/2033	60.991	0,04	USD 290.000	Tenet Healthcare 6,75% 15/5/2031	289.341	0,17
USD 139.000	Sinclair Television 4,125% 1/12/2030	89.682	0,05	USD 37.000	Terex 5% 15/5/2029	34.006	0,02
USD 131.000	Sirius XM Radio 3,125% 1/9/2026	117.666	0,07	USD 16.000	Texas Instruments 2,7% 15/9/2051	10.611	0,01
USD 205.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	189.299	0,11	USD 88.000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/10/2031	70.952	0,04
USD 120.000	Six Flags Entertainment 7,25% 15/5/2031	115.383	0,07	USD 15.000	Thermo Fisher Scientific 4,95% 21/11/2032	15.006	0,01
USD 78.000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	78.050	0,05	USD 6.000	Titan International 7% 30/4/2028	5.719	0,00
USD 86.000	SLM 3,125% 2/11/2026	76.622	0,05	USD 224.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	211.038	0,13
USD 378.000	Sotheby's/Bidfair 5,875% 1/6/2029	292.354	0,17	USD 34.000	Toyota Motor Credit 1,15% 13/8/2027	29.422	0,02
USD 11.000	Spectrum Brands 3,875% 15/3/2031	9.140	0,01	USD 63.000	Toyota Motor Credit 2,15% 13/2/2030	53.604	0,03
USD 18.000	Spectrum Brands 5% 1/10/2029	16.476	0,01	USD 20.000	Toyota Motor Credit 3,05% 22/3/2027	18.761	0,01
USD 15.000	Spectrum Brands 5,5% 15/7/2030	13.934	0,01	USD 6.000	TRI Pointe / TRI Pointe Homes 5,875% 15/6/2024	5.976	0,00
USD 45.000	SRS Distribution 4,625% 1/7/2028	40.140	0,02	USD 29.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	27.651	0,02
USD 99.000	SRS Distribution 6% 1/12/2029	84.751	0,05	USD 5.000	Tri Pointe Homes 5,7% 15/6/2028	4.731	0,00
USD 44.000	SRS Distribution 6,125% 1/7/2029	38.283	0,02	USD 222.000	Triumph 9% 15/3/2028	222.848	0,13
USD 356.000	SS&C Technologies 5,5% 30/9/2027	343.407	0,21	USD 39.000	TTMT Escrow Issuer 8,625% 30/9/2027	40.242	0,02
USD 31.000	Staples 7,5% 15/4/2026	25.721	0,02	USD 2.000	TWDC Enterprises 18 4,125% 1/6/2044	1.687	0,00
USD 15.000	Starwood Property Trust 4,375% 15/1/2027	13.456	0,01	USD 28.000	Twilio 3,625% 15/3/2029	24.070	0,01
USD 32.000	Starwood Property Trust 4,75% 15/3/2025	30.983	0,02	USD 266.000	Twilio 3,875% 15/3/2031	223.734	0,13
USD 33.000	Starwood Property Trust 5,5% 1/11/2023	32.892	0,02				
USD 874.000	State Street 6,552% 15/6/2047	714.142	0,43				
USD 10.000	Steel Dynamics 1,65% 15/10/2027	8.572	0,00				

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
OBLIGATIONS INDEXÉES SUR DES ACTIONS				EUR 1.939	Royal Bank of Canada (Fund receives 5,87% Fixed; and receives/pays return on Danone) (20/9/2023)	114.472	0,07
USD 8.028	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,12% Fixed; and receives/pays return on AT&T) (15/9/2023)	119.106	0,07	USD 1.119	Royal Bank of Canada (Fund receives 7,29% Fixed; and receives/pays return on Fiserv) (15/9/2023)	137.229	0,08
USD 313	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,37% Fixed; and receives/pays return on Thermo Fisher Scientific) (15/9/2023)	176.620	0,11	USD 352	Royal Bank of Canada (Fund receives 8,87% Fixed; and receives/pays return on Becton Dickinson) (26/9/2023)	97.356	0,06
EUR 1.522	Royal Bank of Canada (Fund receives 11,23% Fixed; and receives/pays return on Publicis Groupe) (14/9/2023)	119.592	0,07	USD 1.310	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,03% Fixed; and receives/pays return on Otis Worldwide) (15/9/2023)	113.784	0,07
USD 1.724	Royal Bank of Canada (Fund receives 11,55% Fixed; and receives/pays return on Starbucks) (25/9/2023)	171.952	0,10	USD 327	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,31% Fixed; and receives/pays return on McKesson) (26/9/2023)	137.845	0,08
USD 793	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,05% Fixed; and receives/pays return on Hilton Worldwide) (15/9/2023)	119.444	0,07	USD 565	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,48% Fixed; and receives/pays return on Automatic Data Processing) (15/9/2023)	144.377	0,09
USD 2.642	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,19% Fixed; and receives/pays return on Flex) (18/9/2023)	73.261	0,04	USD 247	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,49% Fixed; and receives/pays return on Humana) (25/9/2023)	117.081	0,07
USD 320	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,61% Fixed; and receives/pays return on Servicenow) (18/9/2023)	187.772	0,11	USD 3.148	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,71% Fixed; and receives/pays return on Apple) (27/9/2023)	592.208	0,35
USD 3.675	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,17% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (15/9/2023)	494.228	0,30	USD 1.933	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,4% Fixed; and receives/pays return on JPMorgan Chase) (16/10/2023)	287.553	0,17
USD 37	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,39% Fixed; and receives/pays return on Booking) (27/9/2023)	115.381	0,07	USD 1.378	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,6% Fixed; and receives/pays return on Paccar) (14/9/2023)	114.539	0,07
USD 823	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,52% Fixed; and receives/pays return on Ebay) (18/9/2023)	36.805	0,02	USD 2.466	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,8% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (27/10/2023)	115.359	0,07
USD 195	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,95% Fixed; and receives/pays return on Parker-Hannifin) (26/9/2023)	82.222	0,05	USD 364	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 11,37% Fixed; and receives/pays return on Vulcan Materials) (26/9/2023)	79.693	0,05
USD 488	Royal Bank of Canada (Fund receives 15,51% Fixed; and receives/pays return on Cigna) (26/9/2023)	137.972	0,08	USD 935	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 12,02% Fixed; and receives/pays return on Johnson Controls International) (25/9/2023)	55.695	0,03
USD 1.663	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,55% Fixed; and receives/pays return on Borgwarner) (25/9/2023)	68.684	0,04	USD 1.468	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 13,62% Fixed; and receives/pays return on Gilead Sciences) (27/9/2023)	112.260	0,07
USD 1.617	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,2% Fixed; and receives/pays return on Fidelity National Information Services) (25/9/2023)	91.430	0,06	USD 718	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 6,7% Fixed; and receives/pays return on Waste Management) (15/9/2023)	113.301	0,07
USD 134	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,89% Fixed; and receives/pays return on United Rentals) (18/9/2023)	62.704	0,04	USD 1.210	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 6,73% Fixed; and receives/pays return on AbbVie) (18/9/2023)	180.116	0,11
USD 672	Royal Bank of Canada (Fund receives 20,12% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	93.345	0,06				

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.884	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,36% Fixed; and receives/pays return on Nasdaq) (11/9/2023)	99.180	0,06	USD 1.238	BNP Paribas (Fund receives 12,46% Fixed; and receives/pays return on Kellogg) (26/9/2023)	76.164	0,04
USD 3.975	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,51% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (18/9/2023)	185.532	0,11	USD 76	BNP Paribas (Fund receives 13,12% Fixed; and receives/pays return on Equinix) (26/9/2023)	59.319	0,03
USD 521	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,52% Fixed; and receives/pays return on YUM! Brands) (25/9/2023)	68.207	0,04	EUR 1.626	BNP Paribas (Fund receives 13,31% Fixed; and receives/pays return on Randstad) (20/9/2023)	95.626	0,06
USD 47	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,7% Fixed; and receives/pays return on Autozone) (19/9/2023)	118.743	0,07	USD 1.472	BNP Paribas (Fund receives 15,35% Fixed; and receives/pays return on Best Buy) (22/11/2023)	113.241	0,07
USD 437	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,97% Fixed; and receives/pays return on HCA Healthcare) (18/9/2023)	122.207	0,07	USD 362	BNP Paribas (Fund receives 16,01% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (27/9/2023)	118.709	0,07
USD 855	BNP Paribas (Fund receives 14,45% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/10/2023)	115.348	0,07	USD 201	BNP Paribas (Fund receives 16,89% Fixed; and receives/pays return on Palo Alto Networks) (17/11/2023)	47.357	0,03
USD 637	Societe Generale (Fund receives 0,2437% Fixed; and receives/pays return on Zimmer Biomet) (21/9/2023)	76.999	0,05	USD 1.222	BNP Paribas (Fund receives 18,83% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	169.136	0,10
USD 503	Societe Generale (Fund receives 0,382% Fixed; and receives/pays return on AmerisourceBergen) (25/9/2023)	89.962	0,05	USD 936	BNP Paribas (Fund receives 27,09% Fixed; and receives/pays return on Comerica) (13/9/2023)	44.959	0,03
USD 1.668	Societe Generale (Fund receives 0,55% Fixed; and receives/pays return on Kraft Heinz) (25/9/2023)	55.753	0,03	USD 607	BNP Paribas (Fund receives 6,2% Fixed; and receives/pays return on McDonald's) (18/9/2023)	172.174	0,10
USD 515	Societe Generale (Fund receives 0,6017% Fixed; and receives/pays return on Elevance Health) (11/9/2023)	235.355	0,14	USD 409	BNP Paribas (Fund receives 8,1% Fixed; and receives/pays return on Stryker) (27/9/2023)	118.035	0,07
USD 2.682	Societe Generale (Fund receives 0,6387% Fixed; and receives/pays return on Synchrony Financial) (11/9/2023)	87.484	0,05	USD 2.350	BNP Paribas (Fund receives 8,37% Fixed; and receives/pays return on CVS Health) (25/9/2023)	156.864	0,09
USD 506	Societe Generale (Fund receives 0,8533% Fixed; and receives/pays return on Arista Networks) (21/9/2023)	97.467	0,06	USD 19	BNP Paribas (Fund receives 9,26% Fixed; and receives/pays return on Chipotle Mexican Grill) (18/9/2023)	36.756	0,02
USD 3.251	Societe Generale (Fund receives 0,9047% Fixed; and receives/pays return on Ally Financial) (11/9/2023)	90.525	0,06	USD 626	BNP Paribas (Fund receives 9,95% Fixed; and receives/pays return on Zoetis) (27/9/2023)	119.765	0,07
USD 2.949	Societe Generale (Fund receives 0,9963% Fixed; and receives/pays return on Mosaic) (25/9/2023)	116.479	0,07	EUR 887	BNP Paribas (Fund receives 9,98% Fixed; and receives/pays return on Essilorluxottica) (20/9/2023)	169.976	0,10
USD 1.173	Societe Generale (Fund receives 1,062% Fixed; and receives/pays return on Citizens Financial) (11/9/2023)	33.265	0,02	USD 2.064	JP Morgan (Fund receives 15,96% Fixed; and receives/pays return on Bank of America) (1/9/2023)	59.930	0,04
USD 1.520	BNP Paribas (Fund receives 10,76% Fixed; and receives/pays return on UnitedHealth) (16/10/2023)	749.102	0,45	USD 115	JP Morgan (Fund receives 17,49% Fixed; and receives/pays return on ServiceNow) (1/9/2023)	62.749	0,04
USD 2.756	BNP Paribas (Fund receives 11,3% Fixed; and receives/pays return on Citigroup) (16/10/2023)	114.980	0,07	USD 1.386	JP Morgan (Fund receives 17,51% Fixed; and receives/pays return on Fortinet) (2/11/2023)	83.095	0,05

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.298	JP Morgan (Fund receives 5,29% Fixed; and receives/pays return on TJX) (29/9/2023)	119.181	0,07	USD 1.829	Nomura (Fund receives 14,81% Fixed; and receives/pays return on Charles Schwab) (8/9/2023)	109.232	0,07
USD 514	JP Morgan (Fund receives 6,14% Fixed; and receives/pays return on Walmart) (17/11/2023)	81.725	0,05	USD 895	Citigroup (Fund receives 10,23% Fixed; and receives/pays return on Kimberly-Clark) (14/9/2023)	115.485	0,07
USD 508	JP Morgan (Fund receives 6,93% Fixed; and receives/pays return on Marsh & McLennan) (12/9/2023)	99.125	0,06	USD 319	Citigroup (Fund receives 10,46% Fixed; and receives/pays return on PPG Industries) (13/9/2023)	45.683	0,03
EUR 1.801	JP Morgan (Fund receives 7,92% Fixed; and receives/pays return on SAP) (14/9/2023)	243.621	0,15	USD 220	Citigroup (Fund receives 10,6% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (1/9/2023)	72.323	0,04
USD 553	JP Morgan (Fund receives 9,93% Fixed; and receives/pays return on Travelers) (12/9/2023)	89.141	0,05	USD 400	Citigroup (Fund receives 10,74% Fixed; and receives/pays return on Apple) (1/9/2023)	73.356	0,04
USD 1.851	UBS (Fund receives 6,3% Fixed; and receives/pays return on Walmart) (2/10/2023)	297.344	0,18	USD 122	Citigroup (Fund receives 11,42% Fixed; and receives/pays return on UnitedHealth) (1/9/2023)	59.958	0,04
GBP 5.527	Barclays (Fund receives 10,42% Fixed; and receives/pays return on Unilever) (20/9/2023)	286.807	0,17	USD 835	Citigroup (Fund receives 11,85% Fixed; and receives/pays return on Caterpillar) (21/9/2023)	237.156	0,14
USD 951	Barclays (Fund receives 11,43% Fixed; and receives/pays return on Agilent Technologies) (29/9/2023)	116.485	0,07	USD 5.014	Citigroup (Fund receives 12,05% Fixed; and receives/pays return on Pfizer) (21/9/2023)	180.277	0,11
USD 305	Barclays (Fund receives 18,9% Fixed; and receives/pays return on Automation) (13/9/2023)	48.389	0,03	USD 329	Citigroup (Fund receives 12,65% Fixed; and receives/pays return on Eaton) (21/9/2023)	74.168	0,04
USD 4.210	Barclays (Fund receives 5,39% Fixed; and receives/pays return on Cisco Systems) (2/10/2023)	239.193	0,14	USD 1.185	Citigroup (Fund receives 12,98% Fixed; and receives/pays return on BJ's Wholesale Club) (17/11/2023)	79.707	0,05
USD 597	Goldman Sachs (Fund receives 10,35% Fixed; and receives/pays return on Starbucks) (2/11/2023)	58.402	0,03	USD 419	Citigroup (Fund receives 13,09% Fixed; and receives/pays return on JP Morgan Chase) (1/9/2023)	61.173	0,04
USD 2.248	Goldman Sachs (Fund receives 11,79% Fixed; and receives/pays return on Target) (29/9/2023)	285.047	0,17	USD 257	Citigroup (Fund receives 13,24% Fixed; and receives/pays return on Danaher) (1/9/2023)	61.030	0,04
USD 854	Goldman Sachs (Fund receives 16,03% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/10/2023)	116.909	0,07	USD 1.028	Citigroup (Fund receives 13,25% Fixed; and receives/pays return on Toll Brothers) (27/10/2023)	82.949	0,05
USD 269	Goldman Sachs (Fund receives 9,61% Fixed; and receives/pays return on Synopsys) (2/10/2023)	121.325	0,07	USD 1.056	Citigroup (Fund receives 13,38% Fixed; and receives/pays return on Bank of New York Mellon) (8/9/2023)	47.359	0,03
USD 1.385	Nomura (Fund receives 11,1% Fixed; and receives/pays return on Archer-Daniels-Midland) (14/9/2023)	111.203	0,07	USD 547	Citigroup (Fund receives 13,49% Fixed; and receives/pays return on PNC Financial Services) (8/9/2023)	66.779	0,04
USD 3.484	Nomura (Fund receives 11,22% Fixed; and receives/pays return on Verizon Communications) (14/9/2023)	120.883	0,07	USD 2.203	Citigroup (Fund receives 14,15% Fixed; and receives/pays return on Flex) (26/10/2023)	59.594	0,04
USD 1.962	Nomura (Fund receives 14,18% Fixed; and receives/pays return on Morgan Stanley) (8/9/2023)	167.451	0,10	USD 2.264	Citigroup (Fund receives 14,25% Fixed; and receives/pays return on Merck & Co) (21/9/2023)	246.231	0,15

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 709	Citigroup (Fund receives 14,35% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (15/9/2023)	234.583	0,14	USD 858	Citigroup (Fund receives 5% Fixed; and receives/pays return on Abbott Laboratories) (12/9/2023)	89.680	0,05
USD 9.757	Citigroup (Fund receives 14,51% Fixed; and receives/pays return on Bank of America) (8/9/2023)	282.868	0,17	USD 199	Citigroup (Fund receives 6,82% Fixed; and receives/pays return on McDonald's) (1/9/2023)	56.555	0,03
USD 2.209	Citigroup (Fund receives 15,38% Fixed; and receives/pays return on General Motors) (14/9/2023)	74.503	0,04	USD 952	Citigroup (Fund receives 8,16% Fixed; and receives/pays return on Sysco) (21/9/2023)	67.186	0,04
USD 274	Citigroup (Fund receives 15,67% Fixed; and receives/pays return on Nucor) (14/9/2023)	47.152	0,03	USD 460	Citigroup (Fund receives 8,57% Fixed; and receives/pays return on Danaher) (14/9/2023)	121.990	0,07
USD 570	Citigroup (Fund receives 16,42% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (1/9/2023)	73.444	0,04	USD 246	Citigroup (Fund receives 9,82% Fixed; and receives/pays return on Gartner) (21/9/2023)	86.195	0,05
USD 597	Citigroup (Fund receives 16,77% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (1/9/2023)	75.091	0,05	Total des obligations indexées sur des actions		14.504.279	8,68
USD 1.684	Citigroup (Fund receives 17,17% Fixed; and receives/pays return on Fifth Third Bancorp) (13/9/2023)	45.114	0,03	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		156.708.956	93,81
USD 1.421	Citigroup (Fund receives 21,35% Fixed; and receives/pays return on Freeport-McMoRan) (12/9/2023)	57.630	0,03	Autres titres négociables			
USD 2.774	Citigroup (Fund receives 24,71% Fixed; and receives/pays return on First Horizon) (11/9/2023)	35.158	0,02	ACTIONS ORDINAIRES			
USD 268	Citigroup (Fund receives 25,99% Fixed; and receives/pays return on Avis Budget) (21/9/2023)	58.610	0,04	1.709	Chypre TCS**	27.344	0,02
				473.134	Royaume-Uni Home Reit**	192.418	0,12
				Total des actions ordinaires		219.762	0,14
				Total des autres valeurs mobilières		219.762	0,14
				Total du portefeuille		156.928.718	93,95
				Autres éléments de l'actif net		10.108.845	6,05
				Total de l'actif net (USD)		167.037.563	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	2.078.587	USD	2.280.579	BNY Mellon	15/9/2023	(24.211)
USD	200.713	EUR	184.190	BNY Mellon	15/9/2023	769
Moins-value nette non réalisée						(23.442)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	97.129.164	USD	123.582.182	BNY Mellon	15/9/2023	(450.213)
USD	1.851.549	GBP	1.457.640	BNY Mellon	15/9/2023	3.679
Moins-value nette non réalisée						(446.534)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	33.808	USD	4.332	BNY Mellon	15/9/2023	(19)
USD	97	HKD	759	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(19)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Global Multi-Asset Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	5.860	USD	4.353	BNY Mellon	15/9/2023	(16)
USD	97	SGD	132	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(16)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 127.431.272)						(470.011)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(76)	USD	EUR/USD Future	Septembre 2023	10.313.675	32.877
(101)	USD	GBP/USD Future	Septembre 2023	8.002.987	(21.540)
(1)	USD	JPY/USD Future	Septembre 2023	85.725	5.269
(25)	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	1.231.625	31.000
2	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	453.575	11.869
(22)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	2.674.375	(34.485)
115	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	12.752.422	108.587
54	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	5.767.453	33.230
50	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	5.799.219	62.109
(14)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	1.812.563	(28.328)
Total				48.893.619	200.588

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
1.610	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.425	20/10/2023	(25.069)	60.663
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.155.220)						(25.069)	60.663

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(1.610)	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.125	20/10/2023	15.641	(18.949)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 559.322)						15.641	(18.949)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Moins-value non réalisée USD
Îles Caïmans			
1.386	Pagseguro Digital	JP Morgan	(1.525)
			(1.525)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 12.613)			(1.525)

ESG Multi-Asset Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Bermudes							
1.137.218	Oakley Capital Investments	5.960.796	0,10				
Guernesey							
26.850.921	Bluefield Solar Income Fund	35.755.371	0,59				
338.067	HarbourVest Global Private Equity	8.851.123	0,14				
8.963	NB Private Equity Partners	160.227	0,00				
23.591.792	Schiehallion Fund	9.512.212	0,16				
24.823.592	Starwood European Real Estate Finance	25.283.847	0,42				
58.595.620	Syncona	90.919.027	1,50				
		170.481.807	2,81				
Irlande							
6.844.197	iShares IV Public Company - iShares MSCI Japan SRI UCITS ETF USD ⁻	40.499.505	0,67				
3.063.717	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻	125.689.335	2,07				
7.344.885	iShares Physical Gold ETC ⁻	256.119.254	4,23				
		422.308.094	6,97				
Jersey							
13.521.612	Foresight Solar Fund	14.661.149	0,24				
Royaume-Uni							
26.159.170	Aquila European Renewables Income Fund	21.712.111	0,36				
137.950.118	Greencoat UK Wind Fund	228.554.542	3,77				
45.174.543	Gresham House Energy Storage Fund	70.184.879	1,16				
1.348.519	HgCapital Trust	6.164.549	0,10				
6.437	ICG Enterprise Trust	80.820	0,00				
544.018	Pantheon International	1.773.409	0,03				
		328.470.310	5,42				
Total des Compartiments		941.882.156	15,54				
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie							
2.424	Ampol	51.087	0,00				
21.979	APA	117.969	0,00				
174.303	Brambles	1.557.856	0,03				
29.113	Cochlear	4.718.908	0,08				
171.789	Coles	1.668.721	0,03				
448.226	Costa	762.680	0,01				
1.925.593	GPT	4.828.525	0,08				
6.086	Lendlease	28.378	0,00				
144.165	National Australia Bank	2.492.638	0,04				
509.348	NEXTDC	4.117.504	0,07				
158.895	Northern Star Resources	1.129.855	0,02				
28.597	Orica	268.224	0,00				
187.920	Scentre	308.536	0,01				
877.232	Transurban	6.944.784	0,11				
		28.995.665	0,48				
Autriche							
63.025	ams-OSRAM	404.761	0,00				
32.545	ANDRITZ	1.610.326	0,03				
21.736	Kontron	440.372	0,01				
60.642	Verbund*	4.611.824	0,08				
		7.067.283	0,12				
Belgique							
41.439	Aedifica	2.556.786	0,04				
188.971	Umicore*	4.633.569	0,08				
		7.190.355	0,12				
Bermudes							
66.189	Bunge	6.996.866	0,12				
86.000	Digital China	25.671	0,00				
216.661	Invesco	3.160.215	0,05				
		10.182.752	0,17				
Îles Vierges britanniques							
15.532	Capri	752.875	0,01				
Canada							
149.649	Bank of Nova Scotia/The	6.580.257	0,11				
318.675	Boralex	7.182.135	0,12				
13.805	Canadian National Railway	1.444.103	0,02				
107.909	Canadian Pacific Kansas City	7.931.196	0,13				
42.441	Canadian Solar	1.114.866	0,02				
34.548	Canfor	469.576	0,01				
71.953	Enbridge	2.347.162	0,04				
94.591	Gildan Activewear	2.628.071	0,04				
223.955	Hydro One	5.546.325	0,09				
26.718	Magna International*	1.451.693	0,03				
121.288	Metro*	5.729.830	0,09				
77.067	Nutrien	4.564.343	0,08				
346.502	RioCan Real Estate Investment Trust*	4.643.551	0,07				
107.520	Shopify	6.427.276	0,11				
462.244	Western Forest Products	292.883	0,00				
		58.353.267	0,96				
Îles Caïmans							
398.044	IHS	2.722.245	0,05				
Danemark							
6.166	Genmab	2.201.003	0,03				
313.923	Novo Nordisk	53.829.642	0,89				
12.266	Novozymes*	490.682	0,01				
169.930	Orsted*	10.058.717	0,17				
6.403	ROCKWOOL	1.517.434	0,03				
207.881	Vestas Wind Systems	4.453.403	0,07				
		72.550.881	1,20				
Finlande							
253.573	Stora Enso	3.001.036	0,05				
133.307	Wartsila	1.571.023	0,03				
		4.572.059	0,08				
France							
61.801	Aéroports de Paris*	7.613.883	0,12				
9.671	Air Liquide	1.628.016	0,03				
551.564	AXA*	15.454.823	0,25				
543.150	BNP Paribas	32.616.158	0,54				
37.766	Cie de Saint-Gobain	2.267.093	0,04				
389.166	Credit Agricole*	4.557.912	0,08				
22.268	Edenred	1.321.383	0,02				
419.526	Getlink	6.496.360	0,11				
10.220	Hermes International	19.595.828	0,32				
1.929	Kering	961.510	0,02				
17.515	L'Oreal	7.188.156	0,12				
33.870	Sanofi	3.370.404	0,06				
369.406	Schneider Electric	58.912.869	0,97				
6.188	Teleperformance	792.373	0,01				
48.769	Worldline	1.482.090	0,02				
		164.258.858	2,71				
Allemagne							
5.133	adidas*	949.605	0,02				
14.407	Bayerische Motoren Werke	1.406.411	0,02				

* Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
7.383	Garmin	725.340	0,01	46.973	American Water Works	6.064.802	0,10
19.378	Kuehne + Nagel International*	5.377.197	0,09	40.529	Amgen	9.600.068	0,16
145.941	Logitech International*	9.326.983	0,16	205.689	Analog Devices	34.529.059	0,57
43.325	Lonza	22.226.911	0,37	5.950	ANSYS	1.741.217	0,03
422.289	Nestle*	47.039.817	0,77	70.769	Apple	12.266.811	0,20
9.311	Roche	2.547.269	0,04	33.645	Applied Materials	4.712.088	0,08
176.975	SIG	4.354.962	0,07	86.590	Archer-Daniels-Midland	6.411.176	0,11
85.929	Swiss Re	7.765.802	0,13	14.593	Arista Networks	2.581.948	0,04
3.197	TE Connectivity	391.645	0,01	3.790	Aspen Technology	684.854	0,01
9.521	Temenos	701.481	0,01	7.275	Autodesk	1.491.014	0,02
2.684	u-blox	220.998	0,00	1.702	Automatic Data Processing	402.006	0,01
67.641	UBS*	1.665.201	0,03	12.337	Badger Meter*	1.898.971	0,03
1.073	VAT*	397.966	0,01	27.502	Ball	1.378.465	0,02
5.858	Zurich Insurance	2.546.814	0,04	28.415	Bank of America	757.553	0,01
		116.612.356	1,93	308.670	Bank of New York Mellon	12.728.657	0,21
	Taiwan			147.297	Best Buy	10.296.376	0,17
10.720	Taiwan Semiconductor Manufacturing	927.500	0,01	8.388	Biogen	2.060.305	0,03
	Émirats arabes unis			5.618	Block	300.332	0,01
2.184.170	Salik	1.836.098	0,03	68.517	Bloom Energy*	974.443	0,02
	Royaume-Uni			5.415	Booking	15.484.188	0,26
301.539	AstraZeneca	37.888.296	0,62	53.948	Boston Scientific	2.707.978	0,04
511.522	Auto Trader	3.639.763	0,06	102.313	Cadence Design Systems	22.770.271	0,38
543.072	Barratt Developments	2.883.917	0,05	67.868	California Water Service	3.189.019	0,05
61.796	Burberry*	1.597.118	0,03	119.517	CECO Environmental	1.467.324	0,02
13.350.685	Forward Partners	4.336.505	0,07	445	Cheniere Energy	67.504	0,00
54.219	Halma	1.363.914	0,02	130.939	Chico's FAS*	617.918	0,01
2.617.303	Helios Towers	2.762.954	0,05	38.414	Cigna	9.958.049	0,16
184.626	HSBC*	1.264.318	0,02	68.517	Cisco Systems	3.617.691	0,06
17.721	InterContinental Hotels	1.237.344	0,02	468.708	Clearway Energy	10.778.668	0,18
1.270.745	ITM Power	1.313.697	0,02	425.601	Coca-Cola	23.677.948	0,39
756.757	J Sainsbury	2.412.083	0,04	640.148	Colgate-Palmolive	43.608.965	0,72
89.928	Johnson Matthey	1.717.925	0,03	240.545	CommScope*	753.820	0,01
86.382	Kingfisher*	236.779	0,00	56.310	Conagra Brands	1.567.936	0,03
1.267.024	National Grid	14.768.379	0,24	15.064	Consolidated Edison	1.250.306	0,02
128.451	Pagegroup	627.944	0,01	1.841	Crown Castle	171.705	0,00
40.081	Pearson	396.094	0,01	260.387	CSX	7.300.804	0,12
624.587	Pennon	4.714.298	0,08	51.418	Cummins	10.990.264	0,18
36.079	Phoenix	218.530	0,00	27.808	Danaher	6.830.861	0,11
1.446.668	RELX	43.643.207	0,72	12.040	Darling Ingredients	699.132	0,01
5.316.440	Rentokil Initial	37.518.840	0,62	34.881	Deere	13.310.426	0,22
84.397.923	Sdcl Energy Efficiency Income Trust	73.070.405	1,21	8.696	Dexcom	825.641	0,01
7.191	Segro	62.208	0,00	22.053	Digital Realty Trust	2.675.560	0,05
135.239	Severn Trent	3.823.573	0,06	89.834	DocGo*	740.236	0,01
1.176.415	Smart Metering Systems	9.337.700	0,15	121.220	Donaldson*	7.136.140	0,12
10.549	Spirax-Sarco Engineering	1.252.882	0,02	41.403	Dover	5.684.900	0,09
118.880	Spirent Communications	216.822	0,00	38.224	Dow	1.933.845	0,03
793.331	SSE	15.118.195	0,25	16.797	Dynatrace	749.788	0,01
3.612.507	Taylor Wimpey	4.858.202	0,08	681.433	eBay*	28.163.132	0,47
139.127	Unilever	6.626.595	0,11	51.305	Ecolab	8.744.516	0,14
602.149	United Utilities	6.644.334	0,11	128.839	Edwards Lifesciences	9.211.563	0,15
		285.552.821	4,70	107.551	Electronic Arts	11.951.155	0,20
	États-Unis			127.195	Elevance Health	53.530.110	0,88
23.758	A O Smith	1.597.231	0,03	13.058	Eli Lilly	6.607.561	0,11
46.944	A10 Networks	658.547	0,01	4.915	Emerson Electric	448.307	0,01
66.681	Adobe	34.277.608	0,57	73.772	EnerSys	7.159.305	0,12
38.275	Advanced Micro Devices	3.788.887	0,06	4.400	Enphase Energy	518.456	0,01
136.401	AECOM	11.112.528	0,18	9.372	Equinix	6.817.114	0,11
66.681	AGCO	8.054.980	0,13	149.272	Essential Utilities	5.127.786	0,09
125.575	Agilent Technologies	14.227.151	0,23	13.223	Estee Lauder	2.012.313	0,03
4.400	Air Products and Chemicals	1.199.415	0,02	146.472	Eversource Energy	8.719.912	0,14
35.778	Alexandria Real Estate Equities	3.869.825	0,06	175.284	Exelon	6.552.883	0,11
557.952	Alphabet	70.320.929	1,16	12.596	F5	1.895.417	0,03
43.051	Amazon.com	5.466.364	0,09	5.026	Fair Isaac	4.213.807	0,07
311.502	American Express*	46.004.134	0,76	36.863	First Solar	6.407.690	0,11
53.756	American Tower	9.043.851	0,15	19.920	Fortinet	1.124.573	0,02
				850	Fox	26.214	0,00
				3.553	FTI Consulting	615.797	0,01
				15.180	Generac*	1.681.917	0,03
				190.481	General Mills	11.947.361	0,20
				83.240	Gilead Sciences	5.895.378	0,10
				3.587	Goldman Sachs	1.091.726	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Finlande				EUR 58.370.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0% 15/8/2050	29.901.125	0,49
EUR 3.440.000	CRH Finland Services 0,875% 5/11/2023	3.420.719	0,06	EUR 33.813.177	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,8% 15/8/2053*	28.037.379	0,46
EUR 10.458.000	Kuntarahoitus 0,05% 10/9/2035	7.206.346	0,12	EUR 3.570.000	Deutsche Bahn Finance 1,375% 28/3/2031*	3.095.833	0,05
USD 3.425.000	Nordea Bank 1,5% 30/9/2026	2.784.996	0,04	USD 12.235.000	Deutsche Bank 1,686% 19/3/2026	10.239.923	0,17
		13.412.061	0,22	EUR 1.600.000	Eurogrid 1,113% 15/5/2032	1.287.695	0,02
France				EUR 11.440.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2% 15/11/2029	10.810.514	0,18
EUR 474.000	AXA 1,375% 7/10/2041	367.319	0,01	EUR 6.900.000	Merck Financial Services 0,5% 16/7/2028	6.008.052	0,10
EUR 8.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel 0,1% 8/10/2027	6.965.878	0,12	EUR 2.453.000	NRW Bank 0,1% 9/7/2035	1.698.690	0,03
EUR 3.100.000	BNP Paribas 0,375% 14/10/2027	2.760.178	0,05			186.104.572	3,07
EUR 8.500.000	BNP Paribas 0,5% 30/5/2028	7.399.760	0,12	International			
USD 3.300.000	BNP Paribas 1,675% 30/6/2027	2.715.393	0,05	EUR 7.000.000	European Investment Bank 0,05% 15/11/2029	5.850.782	0,10
EUR 10.400.000	BNP Paribas 2,125% 23/1/2027	9.852.336	0,16	EUR 29.425.000	European Investment Bank 2,25% 15/3/2030	28.100.728	0,46
USD 4.050.000	BNP Paribas 2,819% 19/11/2025	3.582.150	0,06	EUR 14.666.000	European Investment Bank 2,75% 28/7/2028	14.514.134	0,24
EUR 4.500.000	BNP Paribas 4,125% 24/5/2033	4.513.790	0,07	EUR 72.968.000	European Union 0% 4/3/2026	67.608.136	1,12
USD 760.000	BNP Paribas 4,375% 12/5/2026	674.430	0,01	EUR 2.462.000	European Union 0,1% 4/10/2040	1.435.863	0,02
USD 9.138.000	BPCE 2,045% 19/10/2027*	7.456.802	0,12	EUR 2.458.000	European Union 0,3% 4/11/2050	1.158.013	0,02
EUR 25.700.000	Bpifrance 0% 25/5/2028	22.155.199	0,37	EUR 9.420.000	European Union 2,625% 4/2/2048	8.331.684	0,14
EUR 5.600.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0% 25/11/2026	5.055.792	0,08			126.999.340	2,10
EUR 9.700.000	Cie de Saint-Gobain 1,875% 21/9/2028	8.935.227	0,15	Irlande			
EUR 5.000.000	CNP Assurances SACA 4,25% 5/6/2045*	4.912.593	0,08	EUR 1.340.000	CRH SMW Finance 4,25% 11/7/2035*	1.326.144	0,02
EUR 2.300.000	Credit Agricole 0,125% 9/12/2027	1.967.799	0,03	GBP 456.719	Frost CMBS 2021-1 6,568% 20/11/2033	521.620	0,01
EUR 4.800.000	Credit Agricole 0,375% 21/10/2025	4.469.690	0,07	EUR 40.791.000	Ireland Government Bond 1,35% 18/3/2031	36.644.595	0,61
EUR 6.100.000	Credit Agricole Home Loan SFH 0,01% 12/4/2028*	5.234.715	0,09	USD 2.800.000	Johnson Controls International / Tyco Fire & Security Finance 2% 16/9/2031	2.035.242	0,03
EUR 2.300.000	Credit Mutuel Arkea 1,25% 11/6/2029	2.013.226	0,03	EUR 2.920.000	Johnson Controls International / Tyco Fire & Security Finance 3% 15/9/2028	2.797.089	0,05
EUR 2.300.000	Danone 0,395% 10/6/2029	1.925.478	0,03	EUR 2.900.000	Linde 3,375% 12/6/2029	2.885.761	0,05
EUR 1.600.000	Danone 0,571% 17/3/2027*	1.456.981	0,02	EUR 6.000.000	Linde 3,625% 12/6/2034	5.918.036	0,10
EUR 4.900.000	Danone 1,208% 3/11/2028*	4.392.699	0,07	EUR 9.430.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875% 15/1/2026	9.131.211	0,15
USD 5.615.000	Danone 2,589% 2/11/2023	5.148.738	0,09			61.259.698	1,02
USD 950.000	Danone 2,947% 2/11/2026	818.796	0,01	Italie			
EUR 63.500.000	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/6/2044	36.837.554	0,61	EUR 780.000	Hera 5,2% 29/1/2028	827.755	0,02
EUR 39.810.000	French Republic Government Bond OAT 1,75% 25/6/2039	32.425.245	0,53	EUR 750.000	Iren 1,95% 19/9/2025	718.051	0,01
EUR 1.500.000	Gecina 1,375% 30/6/2027*	1.373.572	0,02	EUR 38.291.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,5% 30/4/2045	23.079.272	0,38
EUR 2.900.000	La Banque Postale 0,75% 23/6/2031*	2.247.629	0,04			24.625.078	0,41
EUR 3.500.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 3,75% 4/7/2035	3.469.865	0,06	Japon			
EUR 3.600.000	Sanofi 1,75% 10/9/2026	3.424.828	0,06	USD 3.105.000	Nissan Motor 4,81% 17/9/2030	2.526.652	0,04
USD 2.145.000	Sanofi 3,625% 19/6/2028	1.905.925	0,03	Jersey			
EUR 1.300.000	Teleperformance 3,75% 24/6/2029	1.217.655	0,02	EUR 2.920.000	Aptiv 1,5% 10/3/2025	2.807.689	0,05
EUR 2.800.000	Veolia Environnement 1,59% 10/1/2028	2.563.371	0,04	USD 1.900.000	Aptiv 3,1% 1/12/2051	1.068.887	0,02
		200.240.613	3,30	USD 1.110.000	Aptiv 4,35% 15/3/2029	984.935	0,01
Allemagne				USD 1.500.000	Aptiv / Aptiv 3,25% 1/3/2032	1.172.677	0,02
EUR 114.547.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0% 15/8/2031*	95.025.361	1,57			6.034.188	0,10

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Luxembourg				Suède			
USD 1.118	Ensemble Investment 0% 11/8/2028	10.238.656	0,17	EUR 8.790.000	Svenska Handelsbanken 0,01% 2/12/2027	7.512.242	0,12
EUR 3.910.000	Nestle Finance International 1,5% 1/4/2030	3.485.081	0,06	EUR 1.730.000	Svenska Handelsbanken 0,05% 6/9/2028	1.437.215	0,02
EUR 5.050.000	Novartis Finance 0% 23/9/2028	4.296.561	0,07	USD 300.000	Svenska Handelsbanken 3,95% 10/6/2027	262.460	0,01
EUR 8.320.000	Novartis Finance 1,625% 9/11/2026	7.836.616	0,13			9.211.917	0,15
		25.856.914	0,43	Royaume-Uni			
Pays-Bas				USD 4.950.000	AstraZeneca 0,7% 8/4/2026	4.085.696	0,07
EUR 8.300.000	ABN AMRO Bank 2,375% 1/6/2027	7.815.823	0,13	USD 1.350.000	AstraZeneca 6,45% 15/9/2037	1.397.639	0,02
EUR 8.920.000	BMW Finance 1% 22/5/2028*	7.998.742	0,13	EUR 3.660.000	Aviva 3,875% 3/7/2044	3.623.601	0,06
USD 5.640.000	Cooperatieve Rabobank 1,004% 24/9/2026	4.699.381	0,08	EUR 1.440.000	BP Capital Markets 1,231% 8/5/2031	1.185.602	0,02
EUR 5.600.000	EDP Finance 1,875% 21/9/2029	5.034.767	0,08	GBP 2.620.000	Close Brothers Finance 1,625% 3/12/2030	2.138.652	0,03
EUR 5.030.000	EDP Finance 3,875% 11/3/2030	5.037.928	0,09	EUR 1.880.000	DS Smith 0,875% 12/9/2026	1.700.939	0,03
EUR 2.400.000	ING Groep 0,875% 9/6/2032	2.055.000	0,03	EUR 7.680.000	DS Smith 4,5% 27/7/2030	7.632.845	0,12
USD 5.230.000	ING Groep 1,4% 1/7/2026	4.429.824	0,08	USD 4.085.000	GlaxoSmithKline Capital 3,375% 1/6/2029	3.502.826	0,06
USD 270.000	ING Groep 4,1% 2/10/2023	248.513	0,00	EUR 4.680.000	GlaxoSmithKline Capital 4% 16/6/2025*	4.740.287	0,08
EUR 6.400.000	ING Groep 4,5% 23/5/2029	6.392.055	0,10	EUR 2.300.000	NatWest 0,75% 15/11/2025	2.201.652	0,04
EUR 600.000	Linde Finance 0,25% 19/5/2027	533.523	0,01	USD 10.900.000	NatWest 4,445% 8/5/2030	9.212.366	0,15
EUR 7.085.000	Nederlandse Waterschapsbank 0% 8/9/2031	5.542.170	0,09	GBP 51.967.500	United Kingdom Gilt 0,875% 31/7/2033*	43.750.040	0,72
EUR 7.963.000	Nederlandse Waterschapsbank 0,375% 28/9/2046	4.171.537	0,07	GBP 13.820.000	United Kingdom Gilt 1,5% 31/7/2053	8.112.397	0,14
EUR 25.624.000	Netherlands Government Bond 0,5% 15/1/2040	17.685.554	0,29			93.284.542	1,54
USD 7.510.000	NXP / NXP Funding 4,875% 1/3/2024	6.881.826	0,11	États-Unis			
USD 10.010.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2,5% 11/5/2031	7.448.462	0,12	USD 2.820.000	Air Products and Chemicals 1,85% 15/5/2027	2.337.657	0,04
USD 500.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4,3% 18/6/2029	431.605	0,01	USD 1.525.000	Air Products and Chemicals 2,05% 15/5/2030	1.187.220	0,02
EUR 10.000.000	Shell International Finance 1,25% 12/5/2028*	9.001.959	0,15	USD 5.000.000	Alexandria Real Estate Equities 2% 18/5/2032	3.494.883	0,06
EUR 3.090.000	Shell International Finance 1,5% 7/4/2028	2.821.390	0,05	USD 3.735.000	Alexandria Real Estate Equities 2,75% 15/12/2029	2.920.640	0,05
EUR 3.900.000	Unilever Finance Netherlands 1,375% 31/7/2029	3.482.924	0,06	USD 6.025.000	Alexandria Real Estate Equities 3,8% 15/4/2026	5.327.465	0,09
		101.712.983	1,68	EUR 3.000.000	American Honda Finance 0,3% 7/7/2028	2.558.295	0,04
Pérou				USD 1.225.000	American Honda Finance 1,3% 9/9/2026	1.007.724	0,02
EUR 9.154.000	Peruvian Government International Bond 1,95% 17/11/2036*	6.605.984	0,11	EUR 7.130.000	American Honda Finance 1,95% 18/10/2024	6.980.056	0,12
Singapour				USD 4.100.000	American Honda Finance 2,3% 9/9/2026	3.471.917	0,06
USD 2.090.000	Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	1.897.540	0,03	EUR 18.080.000	Amgen 2% 25/2/2026	17.340.052	0,29
USD 3.105.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	2.867.828	0,05	USD 6.715.000	Amgen 2,45% 21/2/2030	5.266.657	0,09
		4.765.368	0,08	USD 2.730.000	Amgen 2,6% 19/8/2026	2.336.637	0,04
Corée du Sud				USD 350.000	Amgen 3% 22/2/2029	291.431	0,01
EUR 5.000.000	Korea Housing Finance 0,258% 27/10/2028	4.202.075	0,07	USD 2.185.000	Amgen 4,875% 1/3/2053	1.791.710	0,03
Espagne				USD 2.155.000	Amgen 5,25% 2/3/2033	1.976.734	0,03
EUR 2.300.000	CaixaBank 0,625% 1/10/2024	2.219.871	0,04	USD 6.750.000	Apple 3% 20/6/2027	5.870.073	0,10
EUR 2.300.000	CaixaBank 0,75% 10/7/2026	2.157.676	0,03	USD 715.000	Astrazeneca Finance 0,7% 28/5/2024	636.302	0,01
EUR 51.980.000	Spain Government Bond 1% 30/7/2042	31.916.760	0,53	USD 4.105.000	Astrazeneca Finance 1,75% 28/5/2028	3.279.846	0,05
		36.294.307	0,60	USD 2.775.000	AvalonBay Communities 2,05% 15/1/2032	2.051.406	0,03
				EUR 12.440.000	Bank of America 1,776% 4/5/2027	11.688.375	0,19
				USD 8.600.000	Bank of America 2,551% 4/2/2028	7.164.639	0,12
				USD 5.985.000	Bank of America 2,676% 19/6/2041	3.801.849	0,06

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

ESG Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 2.635.000	Bank of America 2,972% 4/2/2033	1.997.775	0,03	USD 755.453	Fannie Mae Pool 2% 1/10/2051	556.459	0,01
USD 2.600.000	Bank of America 3,194% 23/7/2030	2.100.828	0,03	USD 347.767	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	258.812	0,00
USD 3.350.000	Bank of America 3,366% 23/1/2026	2.977.662	0,05	USD 3.538.096	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	2.604.338	0,04
USD 7.350.000	Bank of America 3,419% 20/12/2028	6.207.235	0,10	USD 4.537.187	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	3.371.763	0,06
EUR 2.580.000	Bank of America 3,648% 31/3/2029	2.524.159	0,04	USD 2.714.993	Fannie Mae Pool 2,5% 1/9/2051	2.081.780	0,03
USD 710.000	Bank of America 3,97% 5/3/2029	611.004	0,01	USD 2.207.974	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2051	1.689.940	0,03
USD 550.000	Bank of America 3,974% 7/2/2030	467.352	0,01	USD 378.919	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2051	292.949	0,00
EUR 6.550.000	Bank of America 4,134% 12/6/2028	6.543.778	0,11	USD 242.049	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2051	187.960	0,00
USD 2.700.000	BMW US Capital 0,75% 12/8/2024	2.380.211	0,04	USD 1.781.873	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2051	1.378.228	0,02
USD 8.550.000	BMW US Capital 1,25% 12/8/2026	7.051.536	0,11	USD 1.104.012	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	854.112	0,01
USD 5.825.000	BorgWarner 2,65% 1/7/2027	4.862.490	0,08	USD 2.361.518	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	1.825.557	0,03
USD 620.000	BorgWarner 3,375% 15/3/2025	551.782	0,01	USD 1.873.731	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2051	1.497.413	0,02
USD 1.510.000	Boston Properties 3,125% 1/9/2023	1.391.775	0,02	USD 941.783	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2051	755.303	0,01
USD 3.625.000	Bristol-Myers Squibb 3,4% 26/7/2029	3.091.789	0,05	USD 1.108.669	Fannie Mae Pool 3,5% 1/5/2052	924.000	0,02
USD 1.500.000	Carrier Global 2,493% 15/2/2027	1.256.236	0,02	USD 469.179	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	399.526	0,01
USD 225.000	Carrier Global 2,7% 15/2/2031	174.099	0,00	USD 1.181.691	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2052	1.008.546	0,02
USD 750.000	Carrier Global 2,722% 15/2/2030	593.382	0,01	USD 1.041.254	Fannie Mae Pool 4,5% 1/5/2052	914.248	0,02
USD 2.775.000	Citigroup 0,776% 30/10/2024	2.534.508	0,04	USD 1.082.641	Fannie Mae Pool 4,5% 1/6/2052	950.587	0,02
USD 1.505.000	City of San Francisco Public Utilities Commission Water Revenue 6% 1/11/2040	1.455.166	0,03	USD 4.154.405	Fannie Mae Pool 4,5% 1/10/2052	3.632.863	0,06
USD 2.775.000	Coca-Cola 1,375% 15/3/2031	2.020.105	0,03	USD 2.833.203	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	2.095.535	0,03
USD 1.600.000	Commonwealth of Massachusetts 3,769% 15/7/2029	1.405.069	0,02	USD 1.050.815	Freddie Mac Pool 2,5% 1/11/2051	812.976	0,01
USD 3.580.000	CRH America 3,875% 18/5/2025	3.198.360	0,05	USD 596.836	Freddie Mac Pool 2,5% 1/11/2051	462.180	0,01
USD 750.000	CRH America Finance 3,4% 9/5/2027	646.378	0,01	USD 957.291	Freddie Mac Pool 2,5% 1/12/2051	744.913	0,01
USD 240.000	CRH America Finance 4,5% 4/4/2048	180.623	0,00	USD 5.003.634	Freddie Mac Pool 2,5% 1/12/2051	3.832.352	0,06
USD 300.000	CSX 2,5% 15/5/2051	168.408	0,00	USD 1.166.548	Freddie Mac Pool 2,5% 1/1/2052	902.393	0,01
USD 2.120.000	CSX 3,25% 1/6/2027	1.839.607	0,03	USD 7.150.201	Freddie Mac Pool 2,5% 1/1/2052	5.476.392	0,09
USD 300.000	CSX 3,8% 1/3/2028	263.160	0,01	USD 634.059	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	503.032	0,01
USD 1.825.000	CSX 4,3% 1/3/2048	1.419.587	0,02	USD 388.928	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	310.816	0,01
USD 1.625.000	CSX 4,5% 15/11/2052	1.306.922	0,02	USD 9.719.231	Freddie Mac Pool 5% 1/8/2052	8.716.868	0,14
USD 1.500.000	East Bay Municipal Utility District Water System Revenue 5,874% 1/6/2040	1.487.975	0,03	USD 11.235.236	Freddie Mac Pool 5,5% 1/12/2052	10.241.250	0,17
USD 1.125.000	Ecolab 1,3% 30/1/2031	808.002	0,01	USD 4.030.000	Freeport-McMoRan 5,4% 14/11/2034	3.521.721	0,06
USD 1.180.000	Ecolab 1,65% 1/2/2027	974.752	0,02	USD 7.110.000	General Mills 4,2% 17/4/2028	6.281.008	0,10
EUR 1.570.000	Ecolab 2,625% 8/7/2025*	1.536.300	0,02	USD 6.450.000	General Mills 4,95% 29/3/2033	5.796.964	0,10
USD 5.700.000	Ecolab 4,8% 24/3/2030	5.225.679	0,09	USD 735.000	Gilead Sciences 0,75% 29/9/2023	675.114	0,01
EUR 9.110.000	Eli Lilly 1,625% 2/6/2026*	8.663.527	0,14	USD 2.000.000	Gilead Sciences 1,65% 1/10/2030	1.480.436	0,02
USD 970.000	Eli Lilly 3,1% 15/5/2027	847.755	0,01				
USD 2.400.000	Eli Lilly 3,375% 15/3/2029	2.065.505	0,03				
USD 7.035.000	EMD Finance 3,25% 19/3/2025	6.249.389	0,10				
EUR 6.140.000	Equinix 0,25% 15/3/2027	5.424.107	0,09				
USD 3.140.000	Equinix 1,25% 15/7/2025	2.667.235	0,04				
USD 7.575.000	Equinix 2,5% 15/5/2031	5.650.378	0,09				
USD 1.370.420	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2051	1.011.665	0,02				
USD 668.980	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2051	496.417	0,01				
USD 950.406	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2051	701.313	0,01				
USD 514.174	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2051	381.717	0,01				
USD 495.933	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2051	366.830	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 2.540.000	Gilead Sciences 2,6% 1/10/2040	1.637.988	0,03	USD 645.183	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/8/2051	544.251	0,01
USD 4.605.000	Gilead Sciences 3,65% 1/3/2026	4.078.809	0,07	USD 6.001.370	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/8/2051	5.230.688	0,09
USD 1.420.000	Gilead Sciences 5,65% 1/12/2041	1.337.122	0,02	USD 89.762	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	75.685	0,00
USD 4.462.705	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/8/2051	3.436.031	0,06	USD 129.808	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	109.338	0,00
USD 9.718.540	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/8/2051	7.636.736	0,13	USD 156.184	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	130.664	0,00
USD 1.957.649	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/8/2051	1.535.651	0,03	USD 1.230.870	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2051	1.037.823	0,02
USD 2.004.843	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/9/2051	1.585.332	0,03	USD 880.857	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2051	743.112	0,01
USD 1.527.666	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/9/2051	1.207.981	0,02	USD 1.199.918	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2051	1.005.005	0,02
USD 1.513.106	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/9/2051	1.186.952	0,02	USD 1.142.959	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2051	993.639	0,02
USD 196.711	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/10/2051	153.697	0,00	USD 673.251	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	567.716	0,01
USD 1.191.076	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/11/2051	930.665	0,02	USD 689.568	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	581.411	0,01
USD 1.570.495	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/1/2052	1.222.418	0,02	USD 858.217	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	723.597	0,01
USD 3.415.305	Ginnie Mae II Pool 3% 20/8/2051	2.872.007	0,05	USD 2.253.481	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	1.908.709	0,03
USD 7.073.413	Ginnie Mae II Pool 3% 20/8/2051	5.940.108	0,10	USD 2.074.561	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	1.756.574	0,03
USD 207.193	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2051	168.090	0,00	USD 4.033.714	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	3.410.627	0,06
USD 235.472	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	191.837	0,00	USD 4.563.235	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2052	3.878.696	0,06
USD 167.192	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	136.120	0,00	USD 986.280	Ginnie Mae II Pool 4% 20/12/2041	853.678	0,01
USD 179.209	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	145.794	0,00	USD 2.606.289	Ginnie Mae II Pool 4% 20/7/2044	2.268.438	0,04
USD 264.137	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	214.285	0,00	USD 940.557	Ginnie Mae II Pool 4% 20/8/2044	812.231	0,01
USD 112.865	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	91.756	0,00	USD 772.486	Ginnie Mae II Pool 4% 20/11/2047	664.903	0,01
USD 1.420.800	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2051	1.154.222	0,02	USD 539.564	Ginnie Mae II Pool 4% 20/3/2050	464.456	0,01
USD 1.096.495	Ginnie Mae II Pool 3% 20/2/2052	890.560	0,01	USD 643.759	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2050	554.173	0,01
USD 1.409.852	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	1.147.756	0,02	USD 997.287	Ginnie Mae II Pool 4% 20/7/2051	870.444	0,01
USD 1.850.290	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	1.505.267	0,02	USD 1.218.651	Ginnie Mae II Pool 4% 20/3/2052	1.047.084	0,02
USD 1.910.905	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	1.553.667	0,03	USD 3.102.759	Ginnie Mae II Pool 4% 20/3/2052	2.716.707	0,04
USD 2.369.299	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	1.922.121	0,03	USD 614.793	Ginnie Mae II Pool 4% 20/4/2052	531.962	0,01
USD 2.139.968	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2052	1.750.215	0,03	USD 1.162.182	Ginnie Mae II Pool 4% 20/4/2052	1.003.326	0,02
USD 29.406	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/1/2041	24.936	0,00	USD 5.162.552	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/1/2050	4.551.416	0,08
USD 63.508	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2042	53.854	0,00	USD 4.448.046	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/1/2050	3.919.920	0,06
USD 110.116	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2042	93.377	0,00	USD 2.392.970	Ginnie Mae II Pool 6% 20/7/2053	2.243.509	0,04
USD 406.967	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/8/2042	345.101	0,01	USD 1.135.000	GlaxoSmithKline Capital 3,625% 15/5/2025	1.019.754	0,02
USD 1.155.536	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2043	979.875	0,02	USD 2.284.142	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-4 5,3% 20/11/2054	1.976.200	0,03
USD 267.577	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2044	226.900	0,00	USD 4.450.000	Healthpeak 2,875% 15/1/2031	3.440.675	0,06
USD 125.716	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	105.892	0,00	USD 2.265.000	Healthpeak 5,25% 15/12/2032	2.016.031	0,03
USD 1.149.841	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/4/2048	966.661	0,02	USD 900.000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust 2,835% 10/8/2038	753.358	0,01

ESG Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 6.610.000	JPMorgan Chase 0,389% 24/2/2028	5.820.634	0,10	USD 4.280.000	Norfolk Southern 5,05% 1/8/2030	3.902.186	0,07
EUR 1.810.000	JPMorgan Chase 1,047% 4/11/2032	1.437.106	0,02	USD 505.000	Novartis Capital 1,75% 14/2/2025	442.989	0,01
USD 4.000.000	JPMorgan Chase 2,947% 24/2/2028	3.383.294	0,06	USD 1.850.000	Novartis Capital 2,2% 14/8/2030	1.454.765	0,02
USD 1.655.000	JPMorgan Chase 3,109% 22/4/2041	1.128.285	0,02	USD 3.855.000	Novartis Capital 3,1% 17/5/2027	3.358.419	0,06
USD 3.050.000	JPMorgan Chase 3,509% 23/1/2029	2.591.710	0,04	USD 11.800.000	NVIDIA 1,55% 15/6/2028	9.437.795	0,16
USD 5.890.000	JPMorgan Chase 3,782% 1/2/2028	5.122.892	0,08	USD 925.000	NVIDIA 2% 15/6/2031	706.221	0,01
USD 1.205.000	JPMorgan Chase 3,845% 14/6/2025	1.091.205	0,02	USD 3.350.000	Pfizer 2,625% 1/4/2030	2.716.224	0,05
USD 6.185.000	JPMorgan Chase 4,005% 23/4/2029	5.343.322	0,09	USD 1.550.000	Pfizer 4% 15/12/2036	1.297.443	0,02
USD 2.950.000	JPMorgan Chase 4,586% 26/4/2033	2.549.328	0,04	USD 6.780.000	Prologis 1,25% 15/10/2030	4.810.896	0,08
USD 1.015.000	Kimberly-Clark 3,05% 15/8/2025	899.756	0,02	USD 1.050.000	Prologis 1,75% 17/2/2030	771.411	0,01
USD 4.645.000	Kimberly-Clark 3,2% 25/4/2029	3.963.078	0,07	USD 925.000	Prologis 1,75% 1/2/2031	673.848	0,01
USD 825.000	Linde 1,1% 10/8/2030	600.228	0,01	USD 1.725.000	Prologis 2,25% 15/1/2032	1.276.963	0,02
USD 1.025.000	Linde 2,65% 5/2/2025	907.899	0,01	USD 1.500.000	Prologis 2,875% 15/11/2029	1.210.585	0,02
USD 1.305.000	Los Angeles Unified School District 5,75% 1/7/2034	1.256.562	0,02	USD 3.755.000	Prologis 3,25% 30/6/2026	3.280.202	0,06
USD 3.025.000	Lowe's 2,5% 15/4/2026	2.604.995	0,04	EUR 3.010.000	Prologis Euro Finance 1% 8/2/2029	2.526.912	0,04
USD 5.650.000	Lowe's 2,625% 1/4/2031	4.372.723	0,07	EUR 6.390.000	Prologis Euro Finance 1,875% 5/1/2029	5.647.605	0,09
USD 6.025.000	Lowe's 3,65% 5/4/2029	5.153.031	0,09	USD 4.770.000	Prudential Financial 1,5% 10/3/2026	4.026.258	0,07
USD 4.105.000	Lowe's 4,65% 15/4/2042	3.309.550	0,05	USD 5.835.000	Public Service Electric and Gas 2,7% 1/5/2050	3.461.494	0,05
USD 6.030.000	Mastercard 1,9% 15/3/2031	4.563.681	0,08	USD 3.900.000	Public Service Electric and Gas 4,9% 15/12/2032	3.553.110	0,06
USD 4.365.000	Mercedes-Benz Finance North America 0,75% 1/3/2024	3.925.797	0,06	USD 6.930.000	Roche 1,93% 13/12/2028	5.527.578	0,09
USD 2.830.000	Mercedes-Benz Finance North America 2,125% 10/3/2025	2.481.035	0,04	USD 2.000.000	Roche 2,076% 13/12/2031	1.503.759	0,02
USD 2.600.000	Merck 1,9% 10/12/2028	2.079.921	0,03	USD 270.000	Roche 3,35% 30/9/2024	244.701	0,00
USD 2.375.000	Merck 3,9% 7/3/2039	1.917.881	0,03	USD 1.920.000	Roche 3,625% 17/9/2028	1.686.793	0,03
USD 1.045.000	Merck 5% 17/5/2053	941.568	0,02	USD 4.930.000	San Diego Gas & Electric 2,95% 15/8/2051	2.973.062	0,05
USD 5.930.000	Metropolitan Life Global Funding I 0,95% 2/7/2025	5.031.319	0,09	USD 2.200.000	Sempra 3,4% 1/2/2028	1.875.658	0,03
EUR 2.260.000	Microsoft 3,125% 6/12/2028	2.279.065	0,04	USD 4.650.000	Sempra 3,8% 1/2/2038	3.492.459	0,06
USD 2.300.000	Microsoft 4,25% 6/2/2047	1.975.506	0,03	USD 11.225.000	Toyota Motor Credit 2,15% 13/2/2030	8.803.118	0,15
USD 2.650.000	Microsoft 4,5% 1/10/2040	2.378.924	0,04	EUR 11.690.000	Toyota Motor Credit 4,05% 13/9/2029	11.839.118	0,20
USD 5.280.000	Morgan Stanley 0,864% 21/10/2025	4.580.106	0,07	USD 970.000	Unilever Capital 3,1% 30/7/2025	861.967	0,02
USD 8.225.000	Morgan Stanley 4,21% 20/4/2028	7.247.386	0,12	USD 2.500.000	Union Pacific 2,375% 20/5/2031	1.934.437	0,03
USD 8.250.000	Morgan Stanley 4,431% 23/1/2030	7.209.008	0,12	USD 3.200.000	Union Pacific 2,8% 14/2/2032	2.521.891	0,04
USD 1.675.000	Morgan Stanley 5,424% 21/7/2034	1.519.180	0,03	USD 1.375.000	Union Pacific 3,2% 20/5/2041	966.594	0,02
USD 6.980.000	Nestle 1,875% 14/9/2031	5.217.325	0,08	USD 8.190.000	Union Pacific 3,95% 10/9/2028	7.262.452	0,12
USD 1.515.000	New York City Municipal Water Finance Authority 5,44% 15/6/2043	1.446.192	0,02	USD 1.470.000	Union Pacific 4,05% 15/11/2045	1.104.946	0,02
USD 1.050.000	Norfolk Southern 2,3% 15/5/2031	798.894	0,01	USD 125.335.800	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/5/2032*	104.940.639	1,73
USD 750.000	Norfolk Southern 3,05% 15/5/2050	462.245	0,01	USD 33.498.800	United States Treasury Note/ Bond 4% 15/11/2052*	29.812.253	0,49
USD 1.100.000	Norfolk Southern 3,15% 1/6/2027	945.719	0,02	EUR 5.000.000	Verizon Communications 0,875% 8/4/2027	4.504.875	0,07
USD 325.000	Norfolk Southern 3,155% 15/5/2055	198.357	0,00	EUR 8.070.000	Verizon Communications 1,3% 18/5/2033	6.233.631	0,10
USD 1.975.000	Norfolk Southern 3,65% 1/8/2025	1.758.821	0,03	EUR 4.220.000	Verizon Communications 1,875% 26/10/2029	3.735.543	0,06
USD 1.625.000	Norfolk Southern 3,8% 1/8/2028	1.411.487	0,02	USD 1.300.000	Verizon Communications 2,355% 15/3/2032	947.837	0,02
USD 400.000	Norfolk Southern 4,15% 28/2/2048	303.399	0,01	USD 4.450.000	Verizon Communications 2,85% 3/9/2041	2.802.809	0,05
USD 2.315.000	Norfolk Southern 4,45% 15/6/2045	1.803.285	0,03	EUR 1.500.000	Verizon Communications 2,875% 15/1/2038	1.261.781	0,02
				USD 2.515.000	Verizon Communications 3,376% 15/2/2025	2.247.273	0,04
				USD 3.855.000	Verizon Communications 3,875% 8/2/2029	3.314.843	0,06
				USD 3.275.000	Verizon Communications 3,875% 1/3/2052	2.265.946	0,03

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Multi-Asset Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	
USD 2.335.000	Verizon Communications 4,329% 21/9/2028	2.060.131	0,03	Autres titres négociables				
USD 630.000	Verizon Communications 4,75% 1/11/2041	522.459	0,01	ACTIONS ORDINAIRES				
USD 5.200.000	Welltower 2,7% 15/2/2027	4.395.187	0,08	Pays-Bas				
USD 4.800.000	WRKCo 3% 15/6/2033	3.584.646	0,06	14.137	DSM BV**	1.293.111	0,02	
USD 4.175.000	WRKCo 3,9% 1/6/2028	3.568.616	0,06	Royaume-Uni				
USD 250.000	WRKCo 4% 15/3/2028	215.236	0,00	42.824.142	Home Reit**	16.052.462	0,27	
USD 9.380.000	WRKCo 4,65% 15/3/2026	8.407.574	0,14	Total des actions ordinaires			17.345.573	0,29
Total des obligations		1.770.358.027	29,22	DROITS				
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		5.892.084.623	97,23	France				
				40.054	Fermentalg (31/12/2049)**	-	0,00	
				Total Droits			-	0,00
				Total des autres valeurs mobilières			17.345.573	0,29
				Total du portefeuille			5.909.430.196	97,53
				Autres éléments de l'actif net			149.884.197	2,47
				Total de l'actif net (EUR)			6.059.314.393	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
AUD	20.000	EUR	12.162	Morgan Stanley	5/9/2023	(222)
EUR	880.540.802	USD	988.260.000	Standard Chartered Bank	18/10/2023	(28.374.469)
EUR	630.853.831	GBP	541.600.000	BNP Paribas	18/10/2023	(675.762)
EUR	630.037.851	USD	695.633.083	BNP Paribas	5/9/2023	(11.099.952)
EUR	31.010.769	CAD	45.260.000	State Street	5/9/2023	176.029
EUR	46.793.276	GBP	40.177.959	Citigroup	5/9/2023	(148.594)
EUR	2.450.706	USD	2.680.000	Standard Chartered Bank	5/9/2023	(19.345)
EUR	3.086.977	USD	3.390.000	Morgan Stanley	5/9/2023	(37.454)
EUR	2.783.738	USD	3.060.000	Deutsche Bank	5/9/2023	(36.545)
EUR	2.287.378	USD	2.530.000	Citigroup	5/9/2023	(44.424)
EUR	7.507.883	GBP	6.480.000	RBS	5/9/2023	(63.017)
EUR	220.823	USD	240.000	RBS	5/9/2023	(376)
EUR	201.884	USD	220.000	Westpac	3/10/2023	(607)
EUR	54.240.114	GBP	46.657.959	Citigroup	3/10/2023	(205.767)
INR	28.618.800.000	USD	342.546.327	HSBC Bank	18/7/2024	(1.436.864)
JPY	9.413.100.000	EUR	61.422.744	Morgan Stanley	18/10/2023	(1.762.451)
JPY	14.223.240.000	USD	104.120.551	Morgan Stanley	18/10/2023	(5.613.999)
TWD	1.539.100.000	USD	49.051.853	UBS	18/10/2023	(595.590)
USD	394.761.369	TWD	12.283.000.000	Goldman Sachs	18/10/2023	7.784.823
USD	5.650.000	EUR	5.155.287	JP Morgan	5/9/2023	52.097
USD	5.780.000	EUR	5.267.821	Deutsche Bank	5/9/2023	59.379
USD	37.728.287	GBP	29.863.695	BNP Paribas	15/9/2023	(120.067)
USD	98.491.730	JPY	14.223.240.000	Morgan Stanley	18/10/2023	437.102
Moins-value nette non réalisée						(41.726.075)
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	9.120.152	EUR	5.413.931	BNY Mellon	15/9/2023	30.439
EUR	238.014	AUD	402.145	BNY Mellon	15/9/2023	(2.052)
Plus-value nette non réalisée						28.387
Catégorie d'Actions couverte en BRL						
BRL	2.885.565	EUR	530.167	BNY Mellon	15/9/2023	8.427
EUR	13.796	BRL	75.040	BNY Mellon	15/9/2023	(210)
Plus-value nette non réalisée						8.217

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Multi-Asset Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	413.241	EUR	52.134	BNY Mellon	15/9/2023	220
EUR	393	CNY	3.122	BNY Mellon	15/9/2023	(3)
Plus-value nette non réalisée						217
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
EUR	877.223	SGD	1.296.005	BNY Mellon	15/9/2023	(6.465)
SGD	43.558.901	EUR	29.497.096	BNY Mellon	15/9/2023	203.830
Plus-value nette non réalisée						197.365
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	20.041.290	USD	21.817.764	BNY Mellon	15/9/2023	(57.586)
USD	656.982.682	EUR	598.911.998	BNY Mellon	15/9/2023	6.313.512
Plus-value nette non réalisée						6.255.926
Catégorie d'Actions couverte en ZAR						
EUR	335.165	ZAR	6.777.237	BNY Mellon	15/9/2023	3.226
ZAR	48.916.339	EUR	2.364.548	BNY Mellon	15/9/2023	31.391
Plus-value nette non réalisée						34.617
Total des moins-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 4.950.445.957)						(35.201.346)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
782	AUD	Australian 10 Year Bond	Septembre 2023	54.322.431	(83.791)
251	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	33.383.000	606.772
(3.272)	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	141.906.640	395.602
(2)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	1.853.439	(5.297)
28	USD	MSCI EAFE Index	Septembre 2023	2.735.235	(25.720)
299	JPY	Nikkei 225 Index	Septembre 2023	61.489.450	(1.459.102)
32	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	6.689.001	198.549
1.007	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	187.023.727	5.477.945
1	EUR	Euro BOBL	Décembre 2023	117.370	400
(55)	EUR	Euro BUXL	Décembre 2023	7.338.100	(57.040)
27	EUR	Euro Schatz	Décembre 2023	2.846.745	4.185
438	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	49.075.634	584.404
(194)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	21.736.696	(315.782)
1.854	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	189.494.561	1.455.800
(733)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	74.918.831	(356.293)
126	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	23.653.412	45.575
896	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	88.204.453	496.274
616	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	73.508.550	1.117.798
(131)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	15.632.500	(276.857)
Total				1.035.929.775	7.803.422

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IFS	EUR 7.933.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,58%	Goldman Sachs	15/3/2052	(926.208)	(926.208)
IFS	EUR 8.514.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,495%	Goldman Sachs	15/4/2052	(1.128.621)	(1.128.621)
IFS	EUR 6.165.389	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,5075%	Goldman Sachs	15/4/2052	(795.039)	(795.039)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Multi-Asset Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IFS	EUR 8.621.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,535%	Goldman Sachs	15/4/2052	(1.042.865)	(1.042.865)
IFS	EUR 73.350.408	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,7575%	Morgan Stanley	15/5/2053	717.493	717.493
IFS	EUR 14.029.656	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,56%	UBS	15/4/2052	(1.594.551)	(1.594.551)
IFS	EUR 17.200.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,585%	UBS	15/4/2052	(1.828.215)	(1.828.215)
TRS	USD 235.517	Fund receives Transition Leaders Long Basket + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 19bps	HSBC Bank	13/12/2023	(258.439)	(258.439)
TRS	USD 235.517	Fund receives Transition Leaders Long Basket + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 19bps	HSBC Bank	13/12/2023	(258.439)	(258.439)
TRS	USD 117.758	Fund receives Transition Leaders Long Basket + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 19bps	HSBC Bank	13/12/2023	(129.219)	(129.219)
TRS	USD 235.516	Fund receives Transition Leaders Long Basket + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 19bps	HSBC Bank	13/12/2023	(258.438)	(258.438)
TRS	USD 177.660	Fund receives Transition Leaders Long Basket + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 19bps	HSBC Bank	13/12/2023	(194.951)	(194.951)
TRS	USD 177.660	Fund receives Transition Leaders Long Basket + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 19bps	HSBC Bank	13/12/2023	(194.951)	(194.951)
TRS	USD 126.170	Fund receives USD SOFR 1 Day - 25bps; and pays Transition Leader Short Basket + 0bps	HSBC Bank	13/12/2023	(793.507)	(793.507)
TRS	USD 188.627	Fund receives USD SOFR 1 Day - 25bps; and pays Transition Leader Short Basket + 0bps	HSBC Bank	13/12/2023	(1.186.310)	(1.186.310)
TRS	USD 188.626	Fund receives USD SOFR 1 Day - 25bps; and pays Transition Leader Short Basket + 0bps	HSBC Bank	13/12/2023	(1.186.304)	(1.186.304)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 323.024.201)					(11.058.564)	(11.058.564)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
283.500.000	Call	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 136	1/3/2033	1.835.429	4.333.878
131.928.490	Put	S&P 500 Index	BNP Paribas	USD 125	15/12/2023	(1.366.587)	18.139
747	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.400	15/12/2023	(2.742.443)	4.888.450
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 128.609.126)						(2.273.601)	9.240.467

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée EUR	Valeur de marché EUR
(747)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3.950	15/12/2023	1.486.203	(1.511.288)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 28.743.298)						1.486.203	(1.511.288)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Irlande							
500	iShares Core EUR Corp Bond UCITS ETF ⁻	62.368	0,07				
6.200	iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF ⁻	617.844	0,67				
126.000	iShares JP Morgan ESG USD EM Bond UCITS ETF ⁻	630.756	0,68				
3.900	iShares USD Corp Bond UCITS ETF ⁻	392.964	0,43				
Total des Compartiments		1.703.932	1,85				
OBLIGATIONS							
Argentine							
USD 265.000	Argentine Republic Government International Bond 0,75% 9/7/2030	89.498	0,10				
USD 75.000	Argentine Republic Government International Bond 1% 9/7/2029	24.504	0,03				
USD 345.000	Argentine Republic Government International Bond 3,5% 9/7/2041	107.124	0,11				
USD 670.000	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2035	201.024	0,22				
USD 45.000	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2046	13.542	0,01				
USD 390.000	Argentine Republic Government International Bond 4,25% 9/1/2038	137.497	0,15				
		573.189	0,62				
Arménie							
USD 200.000	Republic of Armenia International Bond 7,15% 26/3/2025	201.935	0,22				
Australie							
EUR 100.000	APA Infrastructure 2% 22/3/2027	100.536	0,11				
USD 25.000	Ausgrid Finance 4,35% 1/8/2028	23.612	0,03				
USD 20.000	Commonwealth Bank of Australia 2,85% 18/5/2026	18.824	0,02				
USD 172.000	FMG Resources August 2006 5,875% 15/4/2030	160.104	0,17				
USD 213.000	FMG Resources August 2006 6,125% 15/4/2032	198.334	0,22				
EUR 100.000	Goodman Australia Finance 1,375% 27/9/2025	101.639	0,11				
USD 7.000	Mineral Resources 8% 1/11/2027	6.987	0,01				
USD 60.000	Mineral Resources 8,125% 1/5/2027	59.964	0,06				
USD 250.000	Mineral Resources 8,5% 1/5/2030	253.387	0,27				
USD 88.000	Nufarm Australia / Nufarm Americas 5% 27/1/2030	78.559	0,09				
EUR 100.000	Wesfarmers 0,954% 21/10/2033	80.750	0,09				
USD 25.000	Westpac Banking 2,65% 16/1/2030	21.811	0,02				
		1.104.507	1,20				
				Azerbaïdjan			
USD 200.000	Southern Gas Corridor CJSC 6,875% 24/3/2026	202.490	0,22				
				Bahreïn			
USD 250.000	Bahrain Government International Bond 4,25% 25/1/2028	231.785	0,25				
USD 200.000	Bahrain Government International Bond 6% 19/9/2044	161.455	0,18				
USD 200.000	Bahrain Government International Bond 7% 12/10/2028	206.070	0,22				
USD 200.000	CBB International Sukuk Programme WLL 3,875% 18/5/2029	178.468	0,19				
USD 200.000	CBB International Sukuk Programme WLL 6,25% 18/10/2030	201.290	0,22				
		979.068	1,06				
				Barbade			
USD 100.000	Barbados Government International Bond 6,5% 1/10/2029	93.656	0,10				
				Belgique			
EUR 100.000	Elia Transmission Belgium 3,625% 18/1/2033	106.920	0,11				
EUR 100.000	KBC 3% 25/8/2030	102.108	0,11				
EUR 100.000	Ontex 3,5% 15/7/2026	98.583	0,11				
		307.611	0,33				
				Bermudes			
USD 25.000	Aircastle 4,25% 15/6/2026	23.721	0,03				
USD 20.000	Carnival Bermuda 10,375% 1/5/2028	21.790	0,03				
USD 101.000	NCL 5,875% 15/3/2026	95.283	0,10				
USD 45.000	NCL 7,75% 15/2/2029	42.975	0,05				
USD 27.000	NCL 8,375% 1/2/2028	27.837	0,03				
USD 4.000	NCL Finance 6,125% 15/3/2028	3.589	0,00				
USD 110.000	Seadrill Finance 8,375% 1/8/2030	112.818	0,12				
USD 64.000	Valaris 8,375% 30/4/2030	65.306	0,07				
USD 18.000	Viking Cruises 7% 15/2/2029	17.071	0,02				
USD 278.000	Weatherford International 8,625% 30/4/2030	285.170	0,31				
		695.560	0,76				
				Bolivie			
USD 200.000	Bolivian Government International Bond 4,5% 20/3/2028	126.683	0,14				
				Brésil			
USD 200.000	Brazilian Government International Bond 3,75% 12/9/2031	172.458	0,19				
USD 200.000	Brazilian Government International Bond 3,875% 12/6/2030	177.440	0,19				
USD 200.000	Brazilian Government International Bond 4,5% 30/5/2029	189.680	0,21				
USD 200.000	Brazilian Government International Bond 4,625% 13/1/2028	194.552	0,21				

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 200.000	Egypt Government International Bond 7,625% 29/5/2032	115.247	0,13	USD 20.000	TotalEnergies Capital International 2,829% 10/1/2030	17.774	0,02
		559.145	0,61			2.605.482	2,83
	EI Salvador				Gabon		
USD 125.000	EI Salvador Government International Bond 6,375% 18/1/2027	98.148	0,11	USD 200.000	Gabon Government International Bond 6,95% 16/6/2025	168.240	0,18
USD 150.000	EI Salvador Government International Bond 7,125% 20/1/2050	99.731	0,11		Allemagne		
USD 55.000	EI Salvador Government International Bond 7,65% 15/6/2035	39.024	0,04	USD 15.000	Cerdia Finanz 10,5% 15/2/2027	14.795	0,02
USD 50.000	EI Salvador Government International Bond 8,25% 10/4/2032	38.382	0,04	EUR 50.000	Commerzbank 4% 30/3/2027	53.259	0,06
USD 50.000	EI Salvador Government International Bond 8,625% 28/2/2029	38.568	0,04	EUR 25.000	Deutsche Lufthansa 0,25% 6/9/2024	26.066	0,03
		313.853	0,34	EUR 100.000	Deutsche Lufthansa 2,875% 16/5/2027	100.040	0,11
	Finlande			EUR 75.000	E.ON 3,75% 1/3/2029	81.667	0,09
EUR 100.000	Balder Finland 1% 18/1/2027	85.048	0,09	EUR 100.000	Gruenthal 6,75% 15/5/2030	111.695	0,12
EUR 100.000	Elisa 1,125% 26/2/2026	100.953	0,11	USD 65.000	IHO Verwaltungs 6% 15/5/2027	62.085	0,07
EUR 100.000	Nokia 4,375% 21/8/2031	106.245	0,12	USD 25.000	IHO Verwaltungs 6,375% 15/5/2029	23.174	0,02
GBP 100.000	Nordea Bank 1,625% 9/12/2032	101.113	0,11	EUR 100.000	Infineon Technologies 1,625% 24/6/2029	96.164	0,10
EUR 100.000	Nordea Bank 2,875% 24/8/2032	99.692	0,11	EUR 100.000	Infineon Technologies 3,625% 1/1/2028	99.919	0,11
		493.051	0,54	EUR 100.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft in Muenchen 1% 26/5/2042	79.429	0,08
	France			EUR 100.000	Nidda Healthcare 7,5% 21/8/2026	109.562	0,12
EUR 100.000	Altice France 4,125% 15/1/2029	75.993	0,08	EUR 100.000	SAP 1,25% 10/3/2028	99.544	0,11
EUR 100.000	Banijay Entertainment 3,5% 1/3/2025	106.659	0,12	EUR 100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	104.642	0,11
EUR 100.000	Banque Federative du Credit Mutuel 1,125% 19/1/2032	85.022	0,09	EUR 100.000	TK Elevator Midco 4,375% 15/7/2027	99.071	0,11
GBP 100.000	BNP Paribas 2% 24/5/2031	109.125	0,12			1.161.112	1,26
EUR 100.000	BNP Paribas 2,75% 25/7/2028	101.975	0,11		Ghana		
EUR 100.000	BPCE 0,375% 2/2/2026	99.627	0,11	USD 200.000	Ghana Government International Bond 0% 7/4/2025	79.006	0,09
EUR 100.000	CAB SELAS 3,375% 1/2/2028	92.697	0,10	USD 200.000	Ghana Government International Bond 6,375% 11/2/2027	87.490	0,09
EUR 100.000	Cerba Healthcare SACA 3,5% 31/5/2028	95.292	0,10	USD 205.000	Ghana Government International Bond 8,125% 26/3/2032	89.480	0,10
EUR 100.000	CGG 7,75% 1/4/2027	93.678	0,10	USD 250.000	Ghana Government International Bond 8,75% 11/3/2061	104.429	0,11
USD 80.000	CGG 8,75% 1/4/2027	69.082	0,07			360.405	0,39
EUR 100.000	Credit Agricole 0,375% 20/4/2028	92.085	0,10		Grèce		
EUR 100.000	Elior 3,75% 15/7/2026	86.444	0,09	EUR 100.000	Alpha Services and 4,25% 13/2/2030	98.652	0,11
EUR 100.000	Eutelsat 2,25% 13/7/2027	92.417	0,10		Guatemala		
EUR 100.000	Forvia 2,375% 15/6/2029	91.033	0,10	USD 200.000	Guatemala Government Bond 4,65% 7/10/2041	157.620	0,17
EUR 100.000	Getlink 3,5% 30/10/2025	105.955	0,12		Guernesey		
EUR 100.000	JCDecaux 1,625% 7/2/2030	89.639	0,10	USD 50.000	Amdocs 2,538% 15/6/2030	41.145	0,04
EUR 100.000	Loxam 3,75% 15/7/2026	102.225	0,11	EUR 100.000	Sirius Real Estate 1,125% 22/6/2026	93.593	0,10
EUR 100.000	Mobilux Finance 4,25% 15/7/2028	94.883	0,10			134.738	0,14
EUR 100.000	Nexans 5,5% 5/4/2028	112.473	0,12				
EUR 100.000	Orange 2,375% 18/5/2032	98.589	0,11				
EUR 100.000	Pernod Ricard 0,125% 4/10/2029	88.544	0,10				
EUR 100.000	Picard Groupe 3,875% 1/7/2026	100.212	0,11				
EUR 100.000	Renault 1,125% 4/10/2027	93.954	0,10				
EUR 100.000	Rexel 2,125% 15/12/2028	96.398	0,11				
EUR 100.000	Societe Generale 4% 16/11/2027	108.206	0,12				
EUR 100.000	SPIE 2,625% 18/6/2026	103.739	0,11				
EUR 100.000	TotalEnergies 3,369% 6/10/2026	101.762	0,11				

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 150.000	Honduras Honduras Government International Bond 6,25% 19/1/2027	142.298	0,15	USD 100.000	Johnson Controls International / Tyco Fire & Security Finance 1,75% 15/9/2030	80.174	0,09
USD 210.000	Hongrie Hungary Government International Bond 3,125% 21/9/2051	127.347	0,14	USD 25.000	Trane Technologies Financing 5,25% 3/3/2033	24.978	0,03
USD 200.000	Hungary Government International Bond 5,25% 16/6/2029	195.784	0,21	USD 140.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV 5% 15/7/2028	124.014	0,13
USD 200.000	Hungary Government International Bond 5,5% 16/6/2034	190.159	0,21			671.414	0,73
USD 200.000	Hungary Government International Bond 6,125% 22/5/2028	203.137	0,22		Italie		
USD 400.000	Hungary Government International Bond 6,25% 22/9/2032	403.714	0,44	EUR 100.000	Banco BPM 3,25% 14/1/2031	100.900	0,11
USD 130.000	Hungary Government International Bond 7,625% 29/3/2041	143.804	0,15	EUR 150.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	163.802	0,18
USD 200.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 6,125% 4/12/2027	199.151	0,22	EUR 100.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,875% 8/7/2026	101.997	0,11
EUR 100.000	MOL Hungarian Oil & Gas 1,5% 8/10/2027	94.795	0,10	EUR 100.000	Intesa Sanpaolo 1,75% 4/7/2029	93.623	0,10
		1.557.891	1,69	EUR 100.000	Intesa Sanpaolo 2,925% 14/10/2030	92.792	0,10
				USD 20.000	Intesa Sanpaolo 4,95% 1/6/2042	13.348	0,01
				GBP 100.000	Intesa Sanpaolo 5,148% 10/6/2030	106.426	0,12
				EUR 100.000	Mundys 1,875% 13/7/2027	97.648	0,11
				EUR 100.000	Telecom Italia 1,625% 18/1/2029	85.512	0,09
				EUR 100.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	109.714	0,12
				EUR 100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 2,375% 9/11/2027	93.848	0,10
				EUR 200.000	UniCredit 2,731% 15/1/2032	194.476	0,21
				EUR 100.000	Unipol Gruppo 3% 18/3/2025	106.454	0,12
				EUR 100.000	Webuild 5,875% 15/12/2025	107.781	0,12
						1.468.321	1,60
					Jamaïque		
				USD 200.000	Jamaica Government International Bond 7,875% 28/7/2045	227.820	0,25
					Japon		
				USD 50.000	Mitsubishi UFJ Financial 3,287% 25/7/2027	46.398	0,05
				USD 100.000	Mitsubishi UFJ Financial 3,677% 22/2/2027	95.244	0,10
				USD 50.000	Mitsubishi UFJ Financial 3,777% 2/3/2025	48.547	0,05
				EUR 100.000	Mizuho Financial 4,608% 28/8/2030	109.847	0,12
				USD 200.000	Mizuho Financial 5,754% 27/5/2034	199.042	0,22
				EUR 100.000	SoftBank 2,875% 6/1/2027	96.458	0,11
				EUR 100.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032	85.000	0,09
				EUR 100.000	SoftBank 4% 19/9/2029	93.447	0,10
				USD 100.000	Sumitomo Mitsui Financial 2,142% 23/9/2030	79.163	0,09
				USD 50.000	Sumitomo Mitsui Financial 3,784% 9/3/2026	47.908	0,05
						901.054	0,98
					Jersey		
EUR 100.000	Irlande AIB 2,875% 30/5/2031	100.541	0,11	USD 35.000	Adient Global 7% 15/4/2028	35.404	0,04
USD 20.000	Allegion 3,5% 1/10/2029	17.826	0,02	USD 75.000	Aston Martin Capital 10,5% 30/11/2025	75.911	0,08
USD 130.000	Cimpress 7% 15/6/2026	121.758	0,13	GBP 50.000	Heathrow Funding 6,45% 10/12/2031	64.922	0,07
EUR 100.000	James Hardie International Finance 3,625% 1/10/2026	104.907	0,11	USD 45.000	Petrofac 9,75% 15/11/2026	34.580	0,04
USD 75.000	Jazz 4,375% 15/1/2029	67.305	0,08			210.817	0,23
USD 10.000	Johnson Controls International 4,625% 2/7/2044	8.591	0,01				
USD 25.000	Johnson Controls International 4,95% 2/7/2064	21.320	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

(4) Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Jordanie				Malaisie			
USD 200.000	Jordan Government International Bond 5,85% 7/7/2030	185.029	0,20	USD 200.000	Malaysia Sovereign Sukuk 3,043% 22/4/2025	193.561	0,21
USD 250.000	Jordan Government International Bond 7,75% 15/1/2028	256.549	0,28	USD 250.000	Malaysia Wakala Sukuk 2,07% 28/4/2031	210.979	0,23
		441.578	0,48			404.540	0,44
Kazakhstan				Malte			
USD 250.000	Kazakhstan Government International Bond 3,875% 14/10/2024	248.403	0,27	USD 45.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 7,875% 1/5/2027	40.815	0,04
USD 200.000	Kazakhstan Government International Bond 4,875% 14/10/2044	179.181	0,19	USD 48.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 9,5% 1/6/2028	44.814	0,05
		427.584	0,46			85.629	0,09
Kenya				Îles Marshall			
USD 200.000	Republic of Kenya Government International Bond 7% 22/5/2027	177.940	0,19	USD 70.000	Danaos 8,5% 1/3/2028	70.902	0,07
USD 200.000	Republic of Kenya Government International Bond 8% 22/5/2032	166.250	0,18				
		344.190	0,37	Mexique			
Koweït				USD 200.000	Mexico Government International Bond 3,771% 24/5/2061	131.356	0,14
USD 200.000	Kuwait International Government Bond 3,5% 20/3/2027	191.662	0,21	USD 200.000	Mexico Government International Bond 4,75% 27/4/2032	189.823	0,21
Liban				USD 50.000	Mexico Government International Bond 4,75% 8/3/2044	42.042	0,05
USD 100.000	Lebanon Government International Bond 6,6% 27/11/2026***	7.978	0,01	USD 200.000	Mexico Government International Bond 4,875% 19/5/2033	189.757	0,21
USD 100.000	Lebanon Government International Bond 6,65% 3/11/2028***	7.968	0,01	USD 80.000	Mexico Government International Bond 5,55% 21/1/2045	74.703	0,08
		15.946	0,02	USD 50.000	Mexico Government International Bond 5,75% 12/10/2110	43.694	0,05
Liberia				USD 200.000	Mexico Government International Bond 6,35% 9/2/2035	207.719	0,22
USD 53.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 31/8/2026	50.973	0,06	USD 200.000	Mexico Government International Bond 6,75% 27/9/2034	214.967	0,23
USD 265.000	Royal Caribbean Cruises 11,625% 15/8/2027	289.041	0,31			1.094.061	1,19
		340.014	0,37	Mongolie			
Luxembourg				USD 200.000	Mongolia Government International Bond 5,125% 7/4/2026*	185.743	0,20
EUR 100.000	Altice Financing 2,25% 15/1/2025	103.884	0,11	Maroc			
USD 90.000	Altice France 10,5% 15/5/2027	48.681	0,05	USD 200.000	Morocco Government International Bond 3% 15/12/2032	156.382	0,17
USD 25.000	ARD Finance 6,5% 30/6/2027	20.150	0,02	USD 200.000	Morocco Government International Bond 6,5% 8/9/2033	201.335	0,22
EUR 100.000	Dana Financing Luxembourg 3% 15/7/2029	86.080	0,09			357.717	0,39
USD 10.000	DH Europe Finance II 3,4% 15/11/2049	7.467	0,01	Pays-Bas			
EUR 100.000	Eurofins Scientific 0,875% 19/5/2031	82.958	0,09	EUR 100.000	ABN AMRO Bank 4,375% 20/10/2028	108.446	0,12
USD 25.000	Intelsat Jackson 6,5% 15/3/2030	22.942	0,03	EUR 100.000	Axalta Coating Systems Dutch B 3,75% 15/1/2025	107.461	0,12
EUR 100.000	SES 0,875% 4/11/2027	94.836	0,10	USD 50.000	Deutsche Telekom International Finance 8,75% 15/6/2030	58.870	0,06
USD 100.000	Trane Technologies Luxembourg Finance 3,55% 1/11/2024	97.776	0,11	EUR 100.000	Diageo Capital 0,125% 28/9/2028	92.298	0,10
USD 50.000	Trane Technologies Luxembourg Finance 3,8% 21/3/2029	46.602	0,05	GBP 70.000	E.ON International Finance 6,375% 7/6/2032	92.135	0,10
USD 50.000	Tyco Electronics 2,5% 4/2/2032	41.694	0,05				
		653.070	0,71				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

(4) Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 200.000	Philippine Government International Bond 3,2% 6/7/2046	142.695	0,15	USD 154.000	Romanian Government International Bond 5,125% 15/6/2048	128.384	0,14
USD 200.000	Philippine Government International Bond 5% 17/7/2033*	200.247	0,22	USD 76.000	Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027*	74.691	0,08
USD 200.000	Philippine Government International Bond 6,375% 23/10/2034	219.700	0,24	USD 50.000	Romanian Government International Bond 6% 25/5/2034*	48.821	0,05
		1.337.488	1,45	USD 80.000	Romanian Government International Bond 6,125% 22/1/2044	75.676	0,08
	Pologne			USD 70.000	Romanian Government International Bond 6,625% 17/2/2028	72.437	0,08
USD 200.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375% 22/5/2033	196.250	0,21	USD 100.000	Romanian Government International Bond 7,125% 17/1/2033	105.054	0,12
USD 100.000	Republic of Poland Government International Bond 3,25% 6/4/2026	95.751	0,11	USD 100.000	Romanian Government International Bond 7,625% 17/1/2053	107.760	0,12
USD 200.000	Republic of Poland Government International Bond 4,875% 4/10/2033*	194.187	0,21			1.026.411	1,12
USD 125.000	Republic of Poland Government International Bond 5,5% 16/11/2027	127.428	0,14		Arabie Saoudite		
USD 150.000	Republic of Poland Government International Bond 5,5% 4/4/2053	146.188	0,16	USD 260.000	Saudi Government International Bond 4,5% 26/10/2046	220.213	0,24
USD 125.000	Republic of Poland Government International Bond 5,75% 16/11/2032*	130.106	0,14	USD 250.000	Saudi Government International Bond 4,5% 22/4/2060	206.250	0,22
		889.910	0,97	USD 200.000	Saudi Government International Bond 5,5% 25/10/2032	206.563	0,23
	Portugal					633.026	0,69
EUR 100.000	Banco Comercial Portugues 4% 17/5/2032	89.055	0,10		Sénégal		
EUR 100.000	EDP - Energias de Portugal 1,875% 14/3/2082	84.951	0,09	USD 200.000	Senegal Government International Bond 6,25% 23/5/2033	164.062	0,18
		174.006	0,19		Serbie		
	Qatar			USD 200.000	Serbia International Bond 2,125% 1/12/2030	152.796	0,17
USD 200.000	Qatar Government International Bond 3,375% 14/3/2024	197.738	0,21		Singapour		
USD 250.000	Qatar Government International Bond 3,75% 16/4/2030	236.904	0,26	USD 60.000	Flex 4,875% 15/6/2029	57.316	0,06
USD 325.000	Qatar Government International Bond 4,817% 14/3/2049	302.997	0,33		Afrique du Sud		
USD 250.000	Qatar Government International Bond 6,4% 20/1/2040	284.373	0,31	USD 200.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,3% 12/10/2028	177.016	0,19
USD 200.000	QatarEnergy 2,25% 12/7/2031	164.560	0,18	USD 200.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,85% 27/9/2027	187.477	0,21
USD 200.000	QatarEnergy 3,3% 12/7/2051	140.290	0,15	USD 200.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,875% 14/4/2026	193.106	0,21
		1.326.862	1,44	USD 300.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,75% 30/9/2049	213.541	0,23
	Roumanie			USD 250.000	Republic of South Africa Government International Bond 6,25% 8/3/2041	204.190	0,22
USD 100.000	Romanian Government International Bond 3% 27/2/2027	91.853	0,10			975.330	1,06
USD 100.000	Romanian Government International Bond 3% 14/2/2031	82.899	0,09		Espagne		
USD 150.000	Romanian Government International Bond 3,625% 27/3/2032	126.071	0,14	EUR 100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 0,125% 24/3/2027	97.976	0,11
USD 164.000	Romanian Government International Bond 4% 14/2/2051	112.765	0,12	EUR 100.000	Banco de Sabadell 1,125% 11/3/2027	100.141	0,11

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 17.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/4/2030	14.510	0,02	USD 50.000	Booking 3,65% 15/3/2025	48.751	0,05
USD 22.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6,625% 15/1/2028	21.089	0,02	EUR 100.000	BorgWarner 1% 19/5/2031	83.586	0,09
USD 16.000	ASP Unifrax 7,5% 30/9/2029	8.307	0,01	USD 20.000	BP Capital Markets America 3% 24/2/2050	13.343	0,01
USD 25.000	AT&T 2,25% 1/2/2032	19.512	0,02	USD 30.000	Brand Industrial Services 10,375% 1/8/2030	30.810	0,03
USD 50.000	AT&T 3,85% 1/6/2060	34.111	0,04	USD 41.000	Brinker International 8,25% 15/7/2030	40.073	0,04
USD 25.000	AT&T 4,5% 15/5/2035	22.212	0,03	USD 100.000	Bristol-Myers Squibb 1,45% 13/11/2030	79.324	0,09
USD 50.000	AT&T 4,85% 1/3/2039	44.541	0,05	USD 100.000	Bristol-Myers Squibb 3,55% 15/3/2042	79.665	0,09
USD 53.000	AthenaHealth 6,5% 15/2/2030	45.962	0,05	USD 20.000	Bristol-Myers Squibb 4,25% 26/10/2049	16.920	0,02
USD 9.000	ATI 5,125% 1/10/2031	7.966	0,01	USD 2.000	Bristow 6,875% 1/3/2028	1.872	0,00
USD 36.000	ATI 5,875% 1/12/2027	35.072	0,04	USD 20.000	Broadcom 3,137% 15/11/2035	15.268	0,02
USD 50.000	ATI 7,25% 15/8/2030	50.504	0,05	USD 25.000	Broadcom 3,5% 15/2/2041	18.367	0,02
USD 116.000	Atkore 4,25% 1/6/2031	100.340	0,11	USD 13.000	Broadcom 4,11% 15/9/2028	12.233	0,01
USD 25.000	Atmos Energy 3% 15/6/2027	23.437	0,02	USD 70.000	Broadcom 4,15% 15/11/2030	64.015	0,07
USD 20.000	Atmos Energy 4,125% 15/3/2049	16.367	0,02	USD 25.000	Broadcom 4,3% 15/11/2032	22.615	0,02
USD 25.000	Autodesk 2,85% 15/1/2030	21.821	0,02	USD 12.000	Broadcom 4,926% 15/5/2037	10.796	0,01
USD 100.000	Autodesk 3,5% 15/6/2027	94.389	0,10	USD 25.000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3,875% 15/1/2027	23.736	0,03
USD 25.000	AutoNation 3,8% 15/11/2027	22.989	0,03	USD 25.000	Brown & Brown 4,95% 17/3/2052	21.094	0,02
USD 25.000	AutoNation 4,75% 1/6/2030	23.298	0,03	USD 2.000	Brundage-Bone Concrete Pumping 6% 1/2/2026	1.922	0,00
USD 10.000	AvalonBay Communities 4,15% 1/7/2047	8.023	0,01	USD 50.000	Builders FirstSource 4,25% 1/2/2032	42.499	0,05
USD 25.000	Avista 4,35% 1/6/2048	20.537	0,02	USD 297.000	Builders FirstSource 6,375% 15/6/2032	290.012	0,32
USD 50.000	Avnet 5,5% 1/6/2032	47.409	0,05	USD 100.000	Bunge Finance 1,63% 17/8/2025	92.578	0,10
USD 25.000	Baker Hughes 5,125% 15/9/2040	23.718	0,03	USD 60.000	Burford Capital Global Finance 6,875% 15/4/2030	54.672	0,06
USD 80.000	Baker Hughes / Baker Hughes Co-Obligor 4,486% 1/5/2030	77.098	0,08	USD 11.000	Calumet Specialty Products Partners / Calumet Finance 11% 15/4/2025	11.295	0,01
USD 20.000	Baltimore Gas and Electric 4,55% 1/6/2052	17.394	0,02	USD 25.000	Camden Property Trust 3,15% 1/7/2029	22.463	0,02
USD 200.000	Bank of America 1,319% 19/6/2026	184.019	0,20	USD 59.000	Cano Health 6,25% 1/10/2028	14.269	0,02
USD 100.000	Bank of America 2,015% 13/2/2026	94.291	0,10	USD 75.000	Carlisle 2,75% 1/3/2030	63.594	0,07
USD 50.000	Bank of America 2,482% 21/9/2036	38.113	0,04	USD 32.000	Carpenter Technology 7,625% 15/3/2030	32.259	0,04
USD 50.000	Bank of America 2,831% 24/10/2051	32.178	0,04	USD 20.000	Carrier Global 3,577% 5/4/2050	14.342	0,02
USD 25.000	Bank of America 3,95% 21/4/2025	24.201	0,03	USD 44.000	Carrols Restaurant 5,875% 1/7/2029	37.906	0,04
USD 50.000	Bank of America 5% 21/1/2044	47.413	0,05	USD 111.000	Cars.com 6,375% 1/11/2028	102.163	0,11
USD 100.000	Bank of New York Mellon 4,289% 13/6/2033	92.016	0,10	USD 83.000	Carvana 5,875% 1/10/2028	51.140	0,06
USD 117.000	Bausch Health Americas 8,5% 31/1/2027	64.566	0,07	USD 50.000	Carvana 10,25% 1/5/2030	38.811	0,04
USD 23.000	Bausch Health Americas 9,25% 1/4/2026	20.968	0,02	USD 20.000	Caterpillar 3,25% 19/9/2049	15.137	0,02
USD 25.000	Baxter International 2,6% 15/8/2026	23.068	0,03	USD 20.000	Cboe Global Markets 3,65% 12/1/2027	19.131	0,02
USD 16.000	BCPE Ulysses Intermediate 7,75% 1/4/2027	14.779	0,02	USD 25.000	CBRE Services 2,5% 1/4/2031	20.091	0,02
USD 61.000	Beacon Roofing Supply 4,125% 15/5/2029	52.592	0,06	USD 155.000	CBRE Services 4,875% 1/3/2026	151.563	0,16
USD 40.000	Beacon Roofing Supply 6,5% 1/8/2030	39.447	0,04	USD 12.000	CCO / CCO Capital 4,25% 15/1/2034	9.202	0,01
USD 32.000	Beazer Homes USA 5,875% 15/10/2027	30.141	0,03	USD 10.000	CCO / CCO Capital 4,5% 15/8/2030	8.430	0,01
EUR 100.000	Belden 3,375% 15/7/2031	90.458	0,10	USD 50.000	CCO / CCO Capital 4,5% 1/5/2032	40.559	0,04
USD 2.000	Belo 7,75% 1/6/2027	1.994	0,00	USD 67.000	CCO / CCO Capital 4,5% 1/6/2033	52.836	0,06
USD 25.000	Best Buy 1,95% 1/10/2030	20.028	0,02	USD 40.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/2/2032	33.209	0,04
USD 10.000	Biogen 3,15% 1/5/2050	6.541	0,01	USD 50.000	CCO / CCO Capital 5,375% 1/6/2029	45.705	0,05
USD 50.000	Biogen 5,2% 15/9/2045	47.113	0,05	USD 280.000	CCO / CCO Capital 7,375% 1/3/2031	278.582	0,30
USD 50.000	Block Financial 2,5% 15/7/2028	42.793	0,05				
USD 166.000	BlueLinx 6% 15/11/2029	148.436	0,16				
USD 242.000	Boise Cascade 4,875% 1/7/2030	218.492	0,24				

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 89.000	CDI Escrow Issuer 5,75% 1/4/2030	83.165	0,09	USD 39.000	Consolidated Communications 6,5% 1/10/2028	29.933	0,03
USD 50.000	CDW / CDW Finance 4,25% 1/4/2028	46.124	0,05	USD 50.000	Consolidated Edison of New York 3,8% 15/5/2028	47.285	0,05
USD 20.000	Cencora 3,45% 15/12/2027	18.777	0,02	USD 30.000	Consolidated Edison of New York 4,5% 15/5/2058	24.562	0,03
USD 20.000	Cencora 4,3% 15/12/2047	16.704	0,02	USD 20.000	Consolidated Edison of New York 5,5% 1/12/2039	19.307	0,02
USD 10.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	10.135	0,01	USD 61.035	Cooper-Standard Automotive 13,5% 31/3/2027	62.964	0,07
USD 25.000	CF Industries 4,95% 1/6/2043	21.170	0,02	USD 5.000	Cornerstone Building Brands 6,125% 15/1/2029	4.069	0,00
USD 20.000	Charles Schwab 4% 1/2/2029	18.787	0,02	USD 175.000	Coty 5% 15/4/2026	168.419	0,18
USD 22.000	Chemours 5,75% 15/11/2028	19.717	0,02	USD 77.000	Coty/HFC Prestige Products/ HFC Prestige International US 4,75% 15/1/2029	70.621	0,08
USD 150.000	Cheniere Corpus Christi 3,7% 15/11/2029	136.252	0,15	USD 48.000	CPI CG 8,625% 15/3/2026	46.603	0,05
USD 50.000	Chevron 2,954% 16/5/2026	47.626	0,05	USD 35.000	CQP Holdco / BIP-V Chinook Holdco 5,5% 15/6/2031	31.888	0,03
USD 106.000	Chord Energy 6,375% 1/6/2026	103.980	0,11	USD 20.000	Crescent Energy Finance 7,25% 1/5/2026	19.681	0,02
USD 149.000	CHS/Community Health Systems 6,875% 15/4/2029	90.186	0,10	USD 54.000	Crescent Energy Finance 9,25% 15/2/2028	55.273	0,06
USD 20.000	Chubb INA 4,35% 3/11/2045	17.495	0,02	USD 43.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 8% 1/4/2029	44.448	0,05
USD 171.000	Churchill Downs 6,75% 1/5/2031	166.831	0,18	USD 57.000	Crocs 4,25% 15/3/2029	48.115	0,05
USD 50.000	Citigroup 3,2% 21/10/2026	46.621	0,05	USD 100.000	Crown Castle 3,7% 15/6/2026	95.083	0,10
USD 25.000	Citigroup 4,65% 23/7/2048	21.762	0,02	USD 25.000	Crown Castle 4,15% 1/7/2050	18.912	0,02
USD 150.000	Citigroup 4,658% 24/5/2028	146.009	0,16	USD 20.000	CSX 3,8% 1/3/2028	19.034	0,02
USD 25.000	Citigroup 4,75% 18/5/2046	21.019	0,02	USD 65.000	CVR Energy 5,75% 15/2/2028	59.137	0,06
USD 21.000	Civitas Resources 8,75% 1/7/2031	21.706	0,02	USD 20.000	CVS Health 4,125% 1/4/2040	16.335	0,02
USD 32.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,75% 15/5/2028	31.950	0,03	USD 25.000	CVS Health 4,25% 1/4/2050	19.848	0,02
USD 36.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	32.321	0,04	USD 35.000	CVS Health 4,3% 25/3/2028	33.633	0,04
USD 30.000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	30.147	0,03	USD 25.000	Danaher 3,35% 15/9/2025	24.107	0,03
USD 25.000	Cleco Corporate 4,973% 1/5/2046	20.101	0,02	USD 368.000	DaVita 4,625% 1/6/2030	315.856	0,34
USD 77.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	68.874	0,07	USD 20.000	Deere 3,1% 15/4/2030	18.146	0,02
USD 73.000	Cloud Software 9% 30/9/2029	65.288	0,07	USD 50.000	Dell International / EMC 6,02% 15/6/2026	50.512	0,06
USD 25.000	CME 5,3% 15/9/2043	25.291	0,03	USD 5.000	Dell International / EMC 8,35% 15/7/2046	6.137	0,01
USD 22.000	CMG Media 8,875% 15/12/2027	17.281	0,02	USD 90.000	Deluxe 8% 1/6/2029	76.032	0,08
USD 28.000	CNX Midstream Partners 4,75% 15/4/2030	24.189	0,03	USD 25.000	Devon Energy 4,5% 15/1/2030	23.369	0,03
USD 25.000	Coca-Cola 2,5% 1/6/2040	18.082	0,02	USD 25.000	Devon Energy 4,75% 15/5/2042	20.854	0,02
USD 80.000	Coca-Cola 2,75% 1/6/2060	52.128	0,06	USD 50.000	Dick's Sporting Goods 4,1% 15/1/2052	32.458	0,04
USD 50.000	Coca-Cola 3% 5/3/2051	36.207	0,04	USD 394.000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5,875% 15/8/2027	350.022	0,38
USD 105.000	Cogent Communications 3,5% 1/5/2026	97.296	0,11	USD 40.000	DISH DBS 5,75% 1/12/2028	31.152	0,03
USD 250.000	Cogent Communications 7% 15/6/2027	242.725	0,26	USD 70.000	DISH DBS 7,375% 1/7/2028	43.761	0,05
USD 334.000	Coinbase Global 3,375% 1/10/2028	245.964	0,27	USD 62.000	DISH DBS 7,75% 1/7/2026	46.519	0,05
USD 20.000	Columbia Pipeline 4,5% 1/6/2025	19.512	0,02	USD 25.000	Dollar General 4,15% 1/11/2025	24.278	0,03
USD 25.000	Comcast 2,8% 15/1/2051	15.886	0,02	USD 100.000	Domtar 6,75% 1/10/2028	86.474	0,09
USD 25.000	Comcast 3,75% 1/4/2040	20.585	0,02	USD 10.000	Dover 5,375% 15/10/2035	10.000	0,01
USD 50.000	Comcast 3,95% 15/10/2025	48.670	0,05	USD 15.000	Dream Finders Homes 8,25% 15/8/2028	15.222	0,02
USD 137.000	Commercial Metals 4,125% 15/1/2030	121.393	0,13	USD 25.000	eBay 2,7% 11/3/2030	21.384	0,02
USD 73.000	Commercial Metals 4,375% 15/3/2032	62.566	0,07	USD 100.000	Ecolab 2,125% 1/2/2032	81.440	0,09
USD 50.000	Connecticut Light and Power 4% 1/4/2048	40.794	0,04	USD 50.000	Edwards Lifesciences 4,3% 15/6/2028	48.076	0,05
USD 25.000	ConocoPhillips 4,025% 15/3/2062	19.151	0,02	USD 75.000	Electronic Arts 2,95% 15/2/2051	48.625	0,05
USD 10.000	ConocoPhillips 4,3% 15/11/2044	8.594	0,01	USD 125.000	Electronic Arts 4,8% 1/3/2026	123.663	0,13
USD 60.000	ConocoPhillips 5,9% 15/10/2032	64.153	0,07	USD 20.000	Elevance Health 3,7% 15/9/2049	14.944	0,02
				EUR 100.000	Eli Lilly 0,625% 1/11/2031	87.662	0,10
				USD 50.000	Eli Lilly 2,5% 15/9/2060	29.863	0,03

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 34.000	Embarq 7,995% 1/6/2036	20.431	0,02	USD 100.000	FTAI Infra Escrow 10,5% 1/6/2027	100.141	0,11
USD 68.000	Embeta 5% 15/2/2030	55.315	0,06	USD 24.000	FXI 12,25% 15/11/2026	21.600	0,02
USD 35.000	Embeta 6,75% 15/2/2030	30.885	0,03	USD 105.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	111.980	0,12
EUR 100.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	108.519	0,12	USD 187.000	Gartner 3,625% 15/6/2029	164.470	0,18
USD 40.000	Encino Acquisition Partners 8,5% 1/5/2028	37.696	0,04	USD 50.000	Gartner 3,75% 1/10/2030	43.234	0,05
USD 59.000	Encompass Health 4,5% 1/2/2028	54.963	0,06	USD 120.000	Gartner 4,5% 1/7/2028	112.067	0,12
USD 339.000	Encompass Health 4,625% 1/4/2031	297.180	0,32	USD 100.000	GATX 3,25% 15/9/2026	92.826	0,10
USD 45.000	EnerSys 4,375% 15/12/2027	41.233	0,04	USD 74.000	GCI 4,75% 15/10/2028	64.278	0,07
USD 20.000	Enterprise Products Operating 4,15% 16/10/2028	19.084	0,02	USD 20.000	General Mills 2,875% 15/4/2030	17.492	0,02
USD 20.000	Enterprise Products Operating 4,25% 15/2/2048	16.319	0,02	USD 100.000	General Mills 4,95% 29/3/2033	97.510	0,11
USD 38.000	Enviva Partners / Enviva Partners Finance 6,5% 15/1/2026	32.475	0,04	USD 60.000	General Mills 5,4% 15/6/2040	58.490	0,06
USD 50.000	EQT 3,625% 15/5/2031	43.091	0,05	USD 10.000	General Motors 5,2% 1/4/2045	8.268	0,01
USD 50.000	EQT 3,9% 1/10/2027	46.695	0,05	USD 20.000	General Motors Financial 2,35% 8/1/2031	15.546	0,02
USD 10.000	Equinix 3% 15/7/2050	6.333	0,01	USD 25.000	Genuine Parts 1,875% 1/11/2030	19.605	0,02
USD 20.000	ERP Operating 3% 1/7/2029	17.799	0,02	USD 5.000	Genworth 6,5% 15/6/2034	4.296	0,00
USD 20.000	Essential Utilities 3,351% 15/4/2050	13.325	0,01	USD 20.000	Gilead Sciences 3,5% 1/2/2025	19.466	0,02
USD 10.000	Estee Lauder 3,125% 1/12/2049	6.951	0,01	USD 5.000	Global Marine 7% 1/6/2028	4.346	0,00
USD 108.000	Evergreen Acqco 1 / TVI 9,75% 26/4/2028	111.948	0,12	USD 92.000	Global Partners / GLP Finance 6,875% 15/1/2029	86.806	0,09
USD 50.000	Eversource Energy 0,8% 15/8/2025	45.650	0,05	USD 100.000	Goldman Sachs 3,814% 23/4/2029	92.528	0,10
USD 20.000	Eversource Energy 3,45% 15/1/2050	14.096	0,01	USD 100.000	Goldman Sachs 4,017% 31/10/2038	83.160	0,09
USD 50.000	Eversource Energy 5,125% 15/5/2033	48.392	0,05	USD 100.000	Goldman Sachs 4,25% 21/10/2025	96.984	0,11
USD 25.000	Exelon 5,6% 15/3/2053	24.210	0,03	USD 75.000	Goldman Sachs 4,75% 21/10/2045	67.482	0,07
USD 25.000	Exxon Mobil 2,709% 6/3/2025	24.100	0,03	USD 25.000	Golub Capital BDC 2,5% 24/8/2026	21.958	0,02
USD 20.000	Exxon Mobil 3,452% 15/4/2051	14.902	0,02	USD 124.000	GrafTech Global Enterprises 9,875% 15/12/2028	120.327	0,13
USD 20.000	Exxon Mobil 4,227% 19/3/2040	17.891	0,02	USD 15.000	Greystar Real Estate Partners 7,75% 1/9/2030	15.141	0,02
USD 100.000	FactSet Research Systems 3,45% 1/3/2032	84.820	0,09	USD 95.000	GYP III 4,625% 1/5/2029	83.657	0,09
USD 157.000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	143.678	0,16	USD 25.000	Halliburton 2,92% 1/3/2030	21.797	0,02
USD 25.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 6,75% 15/1/2030	20.688	0,02	USD 25.000	HCA 4,625% 15/3/2052	20.091	0,02
USD 50.000	First American Financial 4% 15/5/2030	43.485	0,05	USD 60.000	HCA 5,25% 15/6/2049	52.553	0,06
USD 30.000	Five Point Operating / Five Point Capital 7,875% 15/11/2025	28.144	0,03	USD 10.000	Heartland Dental / Heartland Dental Finance 10,5% 30/4/2028	10.112	0,01
USD 25.000	FMC 3,2% 1/10/2026	23.142	0,03	USD 20.000	Hess 5,6% 15/2/2041	18.869	0,02
GBP 100.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	121.236	0,13	USD 20.000	HF Sinclair 5,875% 1/4/2026	20.103	0,02
USD 200.000	Ford Motor Credit 7,35% 4/11/2027	203.737	0,22	USD 212.000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	183.855	0,20
USD 80.000	Ford Motor Credit 7,35% 6/3/2030	81.519	0,09	USD 240.000	Hilton Domestic Operating 4,875% 15/1/2030	224.037	0,24
USD 100.000	Fortinet 1% 15/3/2026	89.435	0,10	USD 100.000	Hologic 3,25% 15/2/2029	87.126	0,09
USD 28.000	Fortrea 7,5% 1/7/2030	27.664	0,03	USD 25.000	Home Depot 2,7% 15/4/2030	21.964	0,02
USD 68.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 5,5% 1/5/2028	63.317	0,07	USD 20.000	Home Depot 3,3% 15/4/2040	15.806	0,02
USD 58.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 9,75% 1/8/2027	60.354	0,07	USD 20.000	Home Depot 3,35% 15/4/2050	14.677	0,02
USD 13.000	Foundation Building Materials 6% 1/3/2029	11.005	0,01	USD 50.000	Home Depot 4,95% 15/9/2052	47.893	0,05
USD 21.000	Freedom Mortgage 7,625% 1/5/2026	19.322	0,02	USD 65.000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	60.944	0,07
USD 25.000	FS KKR Capital 3,4% 15/1/2026	22.959	0,03	USD 50.000	Hormel Foods 1,8% 11/6/2030	41.367	0,04
				USD 103.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	93.017	0,10
				USD 29.000	Howard Midstream Energy Partners 8,875% 15/7/2028	29.834	0,03
				USD 20.000	HP 1,45% 17/6/2026	18.040	0,02
				USD 50.000	HP 3% 17/6/2027	45.969	0,05
				USD 75.000	HP 3,4% 17/6/2030	65.804	0,07
				USD 10.000	IDEX 2,625% 15/6/2031	8.251	0,01
				USD 150.000	IDEX 3% 1/5/2030	130.349	0,14
				USD 50.000	Illumina 2,55% 23/3/2031	40.209	0,04
				USD 89.000	Installed Building Products 5,75% 1/2/2028	83.659	0,09

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 150.000	Intel 4% 15/12/2032	139.008	0,15	USD 6.000	Lamb Weston 4,125% 31/1/2030	5.290	0,01
USD 25.000	Intercontinental Exchange 1,85% 15/9/2032	19.046	0,02	USD 143.000	Lamb Weston 4,875% 15/5/2028	135.262	0,15
USD 25.000	Intercontinental Exchange 3,75% 1/12/2025	24.126	0,03	USD 27.000	LD 6,125% 1/4/2028	17.623	0,02
USD 10.000	Intercontinental Exchange 4,25% 21/9/2048	8.414	0,01	USD 133.000	LD 6,5% 1/11/2025	111.867	0,12
USD 110.000	International Business Machines 4% 20/6/2042	90.662	0,10	USD 25.000	Lear 3,5% 30/5/2030	21.863	0,02
USD 100.000	International Business Machines 4,15% 27/7/2027	96.585	0,11	USD 20.000	Leggett & Platt 4,4% 15/3/2029	18.912	0,02
USD 25.000	Interpublic of 3,375% 1/3/2041	17.642	0,02	USD 84.000	LGI Homes 4% 15/7/2029	69.424	0,08
USD 50.000	Interpublic of 5,4% 1/10/2048	45.658	0,05	USD 24.000	Liberty Interactive 8,5% 15/7/2029	9.369	0,01
USD 50.000	Intuit 1,65% 15/7/2030	40.417	0,04	USD 10.000	Liberty Mutual 4,3% 1/2/2061	6.057	0,01
EUR 100.000	IQVIA 2,25% 15/3/2029	93.344	0,10	USD 60.000	LifePoint Health 9,875% 15/8/2030	59.226	0,06
USD 26.000	Iron Mountain 5,25% 15/3/2028	24.472	0,03	USD 155.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	93.814	0,10
USD 180.000	Iron Mountain 5,625% 15/7/2032	161.727	0,18	USD 126.000	Louisiana-Pacific 3,625% 15/3/2029	108.515	0,12
USD 160.000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	159.896	0,17	USD 25.000	Lowe's 1,7% 15/10/2030	19.859	0,02
USD 50.000	ITC 2,95% 14/5/2030	42.783	0,05	USD 23.000	Madison IAQ 5,875% 30/6/2029	19.377	0,02
USD 20.000	Jabil 3,6% 15/1/2030	17.905	0,02	USD 25.000	Main Street Capital 3% 14/7/2026	22.157	0,02
USD 50.000	John Deere Capital 1,45% 15/1/2031	39.643	0,04	USD 50.000	Marsh & McLennan 2,25% 15/11/2030	41.350	0,04
USD 16.250	John Sevier Combined Cycle Generation 4,626% 15/1/2042	15.074	0,02	USD 50.000	Marsh & McLennan 4,75% 15/3/2039	46.276	0,05
USD 25.000	Johnson & Johnson 3,7% 1/3/2046	20.954	0,02	USD 25.000	Marsh & McLennan 4,9% 15/3/2049	22.990	0,03
USD 50.000	Johnson & Johnson 4,375% 5/12/2033	49.403	0,05	USD 50.000	Marsh & McLennan 5,45% 15/3/2053	49.468	0,05
USD 250.000	JPMorgan Chase 3,625% 1/12/2027	234.996	0,26	USD 50.000	Martin Marietta Materials 2,4% 15/7/2031	40.484	0,04
USD 50.000	JPMorgan Chase 3,897% 23/1/2049	39.395	0,04	USD 14.000	Martin Midstream Partners / Martin Midstream Finance 11,5% 15/2/2028	14.184	0,02
USD 60.000	JPMorgan Chase 5,5% 15/10/2040	60.664	0,07	USD 25.000	Mastercard 3,85% 26/3/2050	20.802	0,02
USD 50.000	Juniper Networks 2% 10/12/2030	38.743	0,04	USD 60.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	59.018	0,06
USD 80.000	KB Home 7,25% 15/7/2030	80.684	0,09	USD 31.000	Mauser Packaging Solutions 9,25% 15/4/2027	28.147	0,03
USD 20.000	Kellogg 2,1% 1/6/2030	16.394	0,02	USD 40.000	Maxim Crane Works Capital 11,5% 1/9/2028	40.450	0,04
USD 50.000	Kellogg 4,5% 1/4/2046	42.954	0,05	USD 50.000	McCormick 1,85% 15/2/2031	39.308	0,04
USD 13.000	Kennedy-Wilson 4,75% 1/3/2029	10.348	0,01	USD 20.000	McCormick 2,5% 15/4/2030	16.891	0,02
USD 5.000	Kennedy-Wilson 5% 1/3/2031	3.794	0,00	USD 50.000	McDonald's 4,45% 1/3/2047	43.261	0,05
USD 10.000	Keurig Dr Pepper 3,8% 1/5/2050	7.610	0,01	USD 25.000	McKesson 0,9% 3/12/2025	22.625	0,02
USD 70.000	Keurig Dr Pepper 4,05% 15/4/2032	64.125	0,07	GBP 100.000	McKesson 3,125% 17/2/2029	110.549	0,12
USD 20.000	Keurig Dr Pepper 4,5% 15/4/2052	17.017	0,02	USD 66.000	Medline Borrower 5,25% 1/10/2029	58.771	0,06
USD 25.000	Keysight Technologies 3% 30/10/2029	21.865	0,02	USD 10.000	Medtronic 4,625% 15/3/2045	9.393	0,01
USD 10.000	Kimberly-Clark 3,2% 30/7/2046	7.255	0,01	USD 25.000	Merck 2,9% 10/12/2061	15.759	0,02
USD 20.000	Kinder Morgan 5,55% 1/6/2045	18.094	0,02	USD 25.000	Merck 3,7% 10/2/2045	20.401	0,02
USD 10.000	Kinder Morgan 7,75% 15/1/2032	11.177	0,01	USD 50.000	Merck 5% 17/5/2053	48.878	0,05
USD 25.000	Kraft Heinz Foods 5,5% 1/6/2050	24.211	0,03	USD 157.000	Meritage Homes 5,125% 6/6/2027	150.989	0,16
USD 20.000	LABL 9,5% 1/11/2028	20.613	0,02	USD 18.000	Metis Merger Sub 6,5% 15/5/2029	15.670	0,02
USD 15.000	LABL 10,5% 15/7/2027	14.393	0,02	USD 25.000	MetLife 5,7% 15/6/2035	25.597	0,03
USD 25.000	Laboratory of America 1,55% 1/6/2026	22.469	0,02	USD 35.000	Michaels 7,875% 1/5/2029	24.129	0,03
USD 25.000	Laboratory of America 4,7% 1/2/2045	21.440	0,02	USD 60.000	Microsoft 2,675% 1/6/2060	38.717	0,04
USD 10.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,75% 15/6/2029	8.415	0,01	USD 20.000	Microsoft 3,7% 8/8/2046	16.971	0,02
USD 50.000	Lam Research 4% 15/3/2029	47.936	0,05	USD 116.000	MicroStrategy 6,125% 15/6/2028	103.921	0,11
				USD 34.000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4,875% 1/5/2029	29.611	0,03
				USD 16.000	MIWD Holdco II / MIWD Finance 5,5% 1/2/2030	13.548	0,01

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 19.000	Mobius Merger Sub 9% 1/6/2030	17.369	0,02	USD 18.000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 10,75% 1/6/2028	16.771	0,02
USD 171.000	Molina Healthcare 4,375% 15/6/2028	157.459	0,17	USD 50.000	Novartis Capital 2,2% 14/8/2030	42.658	0,05
USD 25.000	Moody's 4,25% 1/2/2029	24.062	0,03	USD 20.000	Novartis Capital 2,75% 14/8/2050	13.749	0,01
USD 97.000	Moog 4,25% 15/12/2027	88.597	0,10	USD 32.000	NRG Energy 5,25% 15/6/2029	28.777	0,03
USD 25.000	Morgan Stanley 1,794% 13/2/2032	19.247	0,02	USD 50.000	NVR 3% 15/5/2030	42.825	0,05
USD 25.000	Morgan Stanley 3,591% 22/7/2028	23.123	0,03	USD 2.000	Oceaneering International 6% 1/2/2028	1.883	0,00
USD 25.000	Morgan Stanley 4,3% 27/1/2045	21.312	0,02	EUR 100.000	Olympus Water US 3,875% 1/10/2028	90.241	0,10
USD 50.000	Morgan Stanley 4,35% 8/9/2026	48.089	0,05	USD 55.000	Olympus Water US 9,75% 15/11/2028	55.453	0,06
USD 100.000	Morgan Stanley 5% 24/11/2025	98.430	0,11	USD 50.000	Omnicom / Omnicom Capital 3,6% 15/4/2026	47.833	0,05
USD 100.000	Morgan Stanley 5,25% 21/4/2034	97.043	0,11	USD 20.000	Oncor Electric Delivery 3,7% 15/5/2050	15.117	0,02
USD 50.000	Morgan Stanley 5,597% 24/3/2051	50.469	0,05	USD 25.000	ONE Gas 2% 15/5/2030	20.539	0,02
USD 30.000	Motorola Solutions 2,3% 15/11/2030	23.919	0,03	USD 31.000	OneMain Finance 7,125% 15/3/2026	30.557	0,03
USD 25.000	Motorola Solutions 2,75% 24/5/2031	20.286	0,02	USD 45.000	OneMain Finance 9% 15/1/2029	45.638	0,05
USD 75.000	Motorola Solutions 4,6% 23/2/2028	72.587	0,08	USD 50.000	ONEOK 4,35% 15/3/2029	46.709	0,05
USD 50.000	Motorola Solutions 5,5% 1/9/2044	45.821	0,05	USD 25.000	ONEOK 4,5% 15/3/2050	18.861	0,02
USD 174.000	MPH Acquisition 5,5% 1/9/2028	147.748	0,16	USD 25.000	ONEOK 6,1% 15/11/2032	25.389	0,03
USD 25.000	MPLX 2,65% 15/8/2030	20.776	0,02	USD 50.000	ONEOK 6,35% 15/1/2031	51.358	0,06
USD 20.000	MPLX 4% 15/3/2028	18.761	0,02	USD 25.000	ONEOK Partners 4,9% 15/3/2025	24.601	0,03
USD 30.000	MPLX 4,7% 15/4/2048	24.165	0,03	USD 100.000	Oracle 2,65% 15/7/2026	92.805	0,10
USD 30.000	MPLX 4,95% 14/3/2052	24.780	0,03	USD 60.000	Oracle 3,6% 1/4/2050	41.573	0,05
USD 20.000	MPLX 5,2% 1/12/2047	17.150	0,02	USD 20.000	Oracle 3,85% 1/4/2060	13.647	0,02
GBP 100.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 3,692% 5/6/2028	86.286	0,09	USD 75.000	Oracle 5,55% 6/2/2053	69.938	0,08
EUR 100.000	Nasdaq 0,9% 30/7/2033	79.463	0,09	USD 14.000	Oscar AcquisitionCo / Oscar Finance 9,5% 15/4/2030	13.115	0,01
USD 25.000	National Fuel Gas 5,5% 15/1/2026	24.775	0,03	USD 25.000	Otis Worldwide 3,112% 15/2/2040	18.838	0,02
USD 25.000	National Rural Utilities Cooperative Finance 2,85% 27/1/2025	24.133	0,03	USD 25.000	Owens Corning 3,875% 1/6/2030	22.758	0,02
USD 20.000	National Rural Utilities Cooperative Finance 4,3% 15/3/2049	16.313	0,02	USD 20.000	Packaging of America 3% 15/12/2029	17.449	0,02
USD 38.000	Nationstar Mortgage 5,5% 15/8/2028	34.575	0,04	USD 25.000	Paramount Global 6,375% 30/3/2062	20.679	0,02
USD 160.000	Nationstar Mortgage 5,75% 15/11/2031	137.371	0,15	USD 19.000	Park River 6,75% 1/8/2029	15.327	0,02
USD 50.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	47.670	0,05	USD 25.000	PayPal 2,85% 1/10/2029	22.080	0,02
USD 25.000	Navient 6,75% 15/6/2026	24.532	0,03	USD 192.000	PBF / PBF Finance 6% 15/2/2028	182.323	0,20
USD 57.000	Navient 9,375% 25/7/2030	57.165	0,06	USD 27.000	PBF / PBF Finance 7,875% 15/9/2030	26.959	0,03
USD 96.000	Neptune Bidco US 9,29% 15/4/2029	89.511	0,10	USD 50.000	PECO Energy 4,375% 15/8/2052	42.714	0,05
USD 101.000	Nestle 1,125% 13/7/2026	92.059	0,10	USD 13.000	PennyMac Financial Services 5,375% 15/10/2025	12.525	0,01
USD 29.000	New Enterprise Stone & Lime 9,75% 15/7/2028	28.776	0,03	USD 100.000	PepsiCo 2,75% 21/10/2051	67.918	0,07
USD 20.000	New York State Electric & Gas 3,3% 15/9/2049	13.206	0,01	USD 50.000	PepsiCo 3,45% 6/10/2046	39.704	0,04
USD 59.000	Nexstar Media 4,75% 1/11/2028	51.831	0,06	USD 100.000	PepsiCo 3,9% 18/7/2032	94.834	0,10
USD 74.000	NFP 6,875% 15/8/2028	65.208	0,07	USD 50.000	Pfizer 0,8% 28/5/2025	46.375	0,05
USD 50.000	NIKE 3,25% 27/3/2040	40.374	0,04	USD 59.000	PG&E 5% 1/7/2028	54.425	0,06
USD 43.000	Nine Energy Service 13% 1/2/2028	39.065	0,04	USD 15.000	PG&E 5,25% 1/7/2030	13.356	0,01
USD 43.000	Noble Finance II 8% 15/4/2030	44.511	0,05	USD 94.000	Pitney Bowes 7,25% 15/3/2029	68.263	0,07
USD 7.000	Nordstrom 4,375% 1/4/2030	5.543	0,01	USD 12.000	PM General Purchaser 9,5% 1/10/2028	11.415	0,01
				USD 95.000	Post 5,5% 15/12/2029	88.210	0,10
				USD 25.000	PPG Industries 2,8% 15/8/2029	22.022	0,02
				USD 20.000	President and Fellows of Harvard College 2,517% 15/10/2050	12.912	0,01
				USD 125.000	PROG 6% 15/11/2029	112.134	0,12
				USD 100.000	Progressive 2,45% 15/1/2027	92.186	0,10
				USD 50.000	Progressive 4,125% 15/4/2047	41.654	0,05

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 100.000	Prologis 4,75% 15/6/2033	95.988	0,10	USD 19.000	Service Properties Trust 7,5% 15/9/2025	18.866	0,02
EUR 100.000	Prologis Euro Finance 1,5% 8/2/2034	80.168	0,09	USD 75.000	ServiceNow 1,4% 1/9/2030	58.928	0,06
USD 20.000	Prudential Financial 3% 10/3/2040	14.830	0,02	USD 19.000	Shea Homes / Shea Homes Funding 4,75% 1/4/2029	16.873	0,02
USD 117.000	PTC 4% 15/2/2028	107.352	0,12	USD 1.091	Shutterfly Finance 9,75% 1/10/2027	1.085	0,00
USD 50.000	Public Service Electric and Gas 3,1% 15/3/2032	43.404	0,05	USD 20.000	Simon Property 2,65% 15/7/2030	16.886	0,02
USD 30.000	Public Service Electric and Gas 5,125% 15/3/2053	29.337	0,03	USD 98.000	Sinclair Television 5,5% 1/3/2030	52.412	0,06
USD 25.000	Public Storage Operating 2,3% 1/5/2031	20.592	0,02	USD 25.000	Skyworks Solutions 3% 1/6/2031	20.360	0,02
USD 25.000	Public Storage Operating 3,385% 1/5/2029	22.959	0,02	USD 60.000	Snap-on 4,1% 1/3/2048	50.616	0,05
USD 20.000	QUALCOMM 4,65% 20/5/2035	19.654	0,02	USD 20.000	Sonoco Products 3,125% 1/5/2030	17.306	0,02
USD 100.000	Quanta Services 2,9% 1/10/2030	84.234	0,09	USD 20.000	Southern California Edison 3,65% 1/3/2028	18.707	0,02
USD 50.000	Quest Diagnostics 4,2% 30/6/2029	47.793	0,05	USD 25.000	Southern California Edison 3,7% 1/8/2025	24.145	0,03
USD 75.000	QVC 4,45% 15/2/2025	67.681	0,07	USD 20.000	Southern California Edison 4,875% 1/3/2049	17.439	0,02
USD 56.000	QVC 5,45% 15/8/2034	27.446	0,03	USD 16.000	Specialty Building Products / SBP Finance 6,375% 30/9/2026	15.220	0,02
USD 24.000	Rackspace Technology Global 5,375% 1/12/2028	7.000	0,01	USD 10.000	Spectra Energy Partners 4,5% 15/3/2045	8.053	0,01
USD 45.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6,5% 15/9/2028	24.350	0,03	USD 9.000	SPX FLOW 8,75% 1/4/2030	8.530	0,01
USD 22.000	Radiology Partners 9,25% 1/2/2028	8.660	0,01	USD 22.000	SRS Distribution 6,125% 1/7/2029	19.141	0,02
USD 17.000	Rain Carbon 12,25% 1/9/2029	17.578	0,02	USD 58.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	53.469	0,06
USD 25.000	Rand Parent 8,5% 15/2/2030	23.867	0,03	USD 22.000	Staples 10,75% 15/4/2027	11.961	0,01
USD 20.000	Raymond James Financial 4,65% 1/4/2030	19.358	0,02	USD 100.000	Steel Dynamics 3,45% 15/4/2030	88.774	0,10
USD 10.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,75% 15/1/2029	7.249	0,01	USD 25.000	StoneX 8,625% 15/6/2025	25.340	0,03
USD 20.000	Realty Income 3% 15/1/2027	18.596	0,02	USD 25.000	STORE Capital 2,75% 18/11/2030	18.156	0,02
USD 20.000	Realty Income 3,25% 15/1/2031	17.324	0,02	USD 25.000	STORE Capital 4,5% 15/3/2028	22.341	0,02
USD 25.000	Regeneron Pharmaceuticals 1,75% 15/9/2030	19.925	0,02	USD 20.000	Stryker 3,5% 15/3/2026	19.208	0,02
USD 70.000	Regeneron Pharmaceuticals 2,8% 15/9/2050	43.565	0,05	USD 100.000	Sunoco / Sunoco Finance 4,5% 15/5/2029	90.121	0,10
USD 50.000	Reliance Steel & Aluminum 2,15% 15/8/2030	40.412	0,04	USD 100.000	Sunoco / Sunoco Finance 5,875% 15/3/2028	96.919	0,11
USD 20.000	RELX Capital 4% 18/3/2029	19.003	0,02	USD 12.000	Synchrony Financial 7,25% 2/2/2033	11.010	0,01
USD 75.000	Republic Services 1,75% 15/2/2032	57.993	0,06	USD 45.000	Talen Energy Supply 8,625% 1/6/2030	46.858	0,05
USD 25.000	Republic Services 2,9% 1/7/2026	23.497	0,03	USD 80.000	Talos Production 12% 15/1/2026	83.481	0,09
USD 20.000	Revvity 3,3% 15/9/2029	17.769	0,02	USD 50.000	Tapestry 3,05% 15/3/2032	38.334	0,04
USD 47.000	Ritchie Bros 7,75% 15/3/2031	48.413	0,05	USD 6.000	Tapestry 4,125% 15/7/2027	5.599	0,01
USD 20.000	Roper Technologies 1,75% 15/2/2031	15.717	0,02	USD 31.000	Taylor Morrison Communities 5,125% 1/8/2030	28.479	0,03
USD 20.000	Roper Technologies 4,2% 15/9/2028	19.041	0,02	USD 119.000	Taylor Morrison Communities 5,75% 15/1/2028	114.889	0,12
USD 25.000	S&P Global 2,3% 15/8/2060	13.618	0,01	USD 25.000	TC PipeLines 3,9% 25/5/2027	23.590	0,03
USD 94.000	Sabre GLBL 11,25% 15/12/2027	89.672	0,10	USD 56.000	TEGNA 4,625% 15/3/2028	50.289	0,06
USD 20.000	San Diego Gas & Electric 3,75% 1/6/2047	15.196	0,02	USD 50.000	Teledyne Technologies 2,75% 1/4/2031	41.759	0,05
USD 25.000	Santander USA 4,5% 17/7/2025	24.393	0,03	USD 91.000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	78.488	0,09
USD 20.000	Schlumberger 3,9% 17/5/2028	18.956	0,02	USD 98.000	Tenet Healthcare 6,125% 1/10/2028	94.439	0,10
USD 57.000	Science Applications International 4,875% 1/4/2028	52.534	0,06	USD 140.000	Tenet Healthcare 6,25% 1/2/2027	138.105	0,15
USD 9.000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6,625% 1/3/2030	7.942	0,01	USD 32.000	Tenet Healthcare 6,75% 15/5/2031	31.927	0,03
USD 61.000	Service Properties Trust 5,25% 15/2/2026	56.218	0,06	USD 39.000	Tenet Healthcare 6,875% 15/11/2031	38.998	0,04

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 71.000	Tenneco 8% 17/11/2028	58.423	0,06	USD 30.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/4/2026	29.712	0,03
USD 32.000	Texas Capital Bancshares 4% 6/5/2031	26.519	0,03	USD 64.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/9/2027	62.465	0,07
USD 25.000	Texas Eastern Transmission 3,5% 15/1/2028	23.083	0,02	USD 25.000	Valvoline 3,625% 15/6/2031	19.905	0,02
USD 20.000	Texas Instruments 1,75% 4/5/2030	16.684	0,02	USD 19.000	Varex Imaging 7,875% 15/10/2027	18.995	0,02
USD 80.000	Texas Instruments 3,65% 16/8/2032	73.044	0,08	USD 45.000	Venture Global Calcasieu Pass 6,25% 15/1/2030	43.796	0,05
USD 50.000	Texas Instruments 5% 14/3/2053	48.671	0,05	USD 59.000	Venture Global LNG 8,125% 1/6/2028	59.464	0,06
USD 226.000	Thor Industries 4% 15/10/2029	190.152	0,21	USD 30.000	Venture Global LNG 8,375% 1/6/2031	30.270	0,03
USD 50.000	T-Mobile USA 3,3% 15/2/2051	33.625	0,04	USD 50.000	VeriSign 5,25% 1/4/2025	49.633	0,05
USD 75.000	T-Mobile USA 3,6% 15/11/2060	50.328	0,06	USD 50.000	Verisk Analytics 3,625% 15/5/2050	35.674	0,04
USD 31.000	TopBuild 4,125% 15/2/2032	25.834	0,03	USD 33.000	Veritas US / Veritas Bermuda 7,5% 1/9/2025	27.093	0,03
USD 113.000	Townsquare Media 6,875% 1/2/2026	107.904	0,12	USD 25.000	Verizon Communications 1,75% 20/1/2031	19.461	0,02
USD 25.000	Toyota Motor Credit 0,8% 9/1/2026	22.650	0,02	USD 70.000	Verizon Communications 2,65% 20/11/2040	46.820	0,05
USD 25.000	Toyota Motor Credit 3,375% 1/4/2030	22.762	0,02	USD 25.000	Verizon Communications 5,25% 16/3/2037	24.465	0,03
USD 100.000	Tractor Supply 5,25% 15/5/2033	97.865	0,11	USD 5.000	Vertiv 4,125% 15/11/2028	4.494	0,00
USD 20.000	Transcontinental Gas Pipe Line 3,95% 15/5/2050	15.008	0,02	USD 98.000	Viasat 6,5% 15/7/2028	76.283	0,08
USD 20.000	Transcontinental Gas Pipe Line 4% 15/3/2028	18.846	0,02	USD 13.000	Vibrantz Technologies 9% 15/2/2030	10.572	0,01
USD 10.000	Travelers 4% 30/5/2047	8.245	0,01	USD 25.000	VICI Properties 5,625% 15/5/2052	22.024	0,02
USD 39.000	Tri Pointe Homes 5,7% 15/6/2028	36.904	0,04	USD 100.000	VICI Properties / VICI Note 3,75% 15/2/2027	91.810	0,10
USD 15.000	Trident TPI 12,75% 31/12/2028	15.622	0,02	USD 25.000	Visa 3,65% 15/9/2047	20.429	0,02
USD 25.000	Trimble 4,9% 15/6/2028	24.258	0,03	USD 23.000	Vital Energy 7,75% 31/7/2029	20.722	0,02
USD 88.000	TriNet 3,5% 1/3/2029	75.678	0,08	USD 23.000	Vital Energy 9,5% 15/1/2025	23.139	0,02
USD 75.000	TriNet 7,125% 15/8/2031	75.154	0,08	USD 21.000	Vital Energy 10,125% 15/1/2028	21.338	0,02
USD 15.000	Tronox 4,625% 15/3/2029	12.325	0,01	USD 20.000	VT Topco 8,5% 15/8/2030	20.350	0,02
USD 25.000	TTMT Escrow Issuer 8,625% 30/9/2027	25.796	0,03	USD 20.000	Vulcan Materials 3,5% 1/6/2030	17.923	0,02
USD 2.000	Tutor Perini 6,875% 1/5/2025	1.799	0,00	USD 66.000	Wabash National 4,5% 15/10/2028	56.021	0,06
USD 25.000	Uber Technologies 7,5% 15/9/2027	25.483	0,03	USD 25.000	Walt Disney 2% 1/9/2029	21.214	0,02
USD 50.000	Union Pacific 3,6% 15/9/2037	41.854	0,05	USD 25.000	Walt Disney 3,5% 13/5/2040	20.038	0,02
USD 85.000	Unisys 6,875% 1/11/2027	66.113	0,07	USD 25.000	Washington Gas Light 3,65% 15/9/2049	17.945	0,02
USD 25.000	United Parcel Service 5,3% 1/4/2050	25.402	0,03	USD 14.000	Weekley Homes / Weekley Finance 4,875% 15/9/2028	12.391	0,01
USD 55.000	United Wholesale Mortgage 5,5% 15/11/2025	52.871	0,06	USD 250.000	Wells Fargo 4,54% 15/8/2026	244.020	0,27
USD 254.000	United Wholesale Mortgage 5,75% 15/6/2027	235.203	0,26	USD 20.000	Welltower 3,1% 15/1/2030	17.398	0,02
USD 10.000	UnitedHealth 2,9% 15/5/2050	6.655	0,01	EUR 100.000	Westlake 1,625% 17/7/2029	91.852	0,10
USD 150.000	UnitedHealth 3,5% 15/8/2039	122.315	0,13	USD 100.000	Weyerhaeuser 3,375% 9/3/2033	85.047	0,09
USD 50.000	UnitedHealth 3,95% 15/10/2042	41.645	0,05	USD 25.000	Weyerhaeuser 4% 15/4/2030	22.866	0,02
USD 80.000	UnitedHealth 4,45% 15/12/2048	70.356	0,08	USD 27.000	White Cap Parent 8,25% 15/3/2026	26.474	0,03
USD 104.000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 6,5% 15/2/2029	71.233	0,08	USD 25.000	Williams 3,5% 15/11/2030	22.129	0,02
USD 221.000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	220.271	0,24	USD 40.000	Williams 5,1% 15/9/2045	35.289	0,04
USD 10.000	University of Southern California 2,805% 1/10/2050	6.601	0,01	USD 110.000	Williams Scotsman International 4,625% 15/8/2028	100.115	0,11
USD 50.000	Univision Communications 6,625% 1/6/2027	48.553	0,05	USD 25.000	Willis North America 2,95% 15/9/2029	21.654	0,02
USD 20.000	Univision Communications 7,375% 30/6/2030	19.439	0,02	USD 25.000	Windsor III 8,5% 15/6/2030	25.146	0,03
USD 10.000	Univision Communications 8% 15/8/2028	10.015	0,01	USD 16.000	World Acceptance 7% 1/11/2026	13.936	0,02
USD 95.000	Upbound 6,375% 15/2/2029	84.873	0,09	USD 20.000	WR Grace 7,375% 1/3/2031	19.764	0,02
USD 75.000	US Bancorp 3% 30/7/2029	64.238	0,07	USD 114.000	WW International 4,5% 15/4/2029	79.903	0,09
USD 186.000	US Foods 4,75% 15/2/2029	169.712	0,18	USD 18.000	XPO CNW 6,7% 1/5/2034	17.780	0,02

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 100.000	Yum! Brands 4,625% 31/1/2032	89.481	0,10	USD 100.000	Uruguay Government International Bond 5,75% 28/10/2034	107.425	0,12
USD 93.000	Yum! Brands 4,75% 15/1/2030	85.763	0,09	USD 100.000	Uruguay Government International Bond 7,625% 21/3/2036	120.875	0,13
USD 125.000	Yum! Brands 5,375% 1/4/2032	117.392	0,13	USD 100.000	Uruguay Government International Bond 7,875% 15/1/2033	120.937	0,13
USD 38.000	Zayo 6,125% 1/3/2028	24.720	0,03			1.169.660	1,27
USD 65.000	Ziff Davis 4,625% 15/10/2030	56.190	0,06				
USD 25.000	Zoetis 2% 15/5/2030	20.589	0,02				
USD 20.000	Zoetis 3,9% 20/8/2028	19.098	0,02				
USD 20.000	Zoetis 4,7% 1/2/2043	18.149	0,02				
USD 80.000	Zoetis 5,6% 16/11/2032	82.490	0,09				
		33.418.118	36,31				
	Uruguay				Uzbekistan		
USD 65.000	Uruguay Government International Bond 4,125% 20/11/2045	57.413	0,06	USD 200.000	Republic of Uzbekistan International Bond 5,375% 20/2/2029	183.323	0,20
USD 90.000	Uruguay Government International Bond 4,375% 27/10/2027	89.807	0,10				
USD 150.000	Uruguay Government International Bond 4,375% 23/1/2031	147.769	0,16	Total des obligations		88.575.808	96,23
USD 215.000	Uruguay Government International Bond 4,975% 20/4/2055	202.640	0,22	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		90.279.740	98,08
USD 335.000	Uruguay Government International Bond 5,1% 18/6/2050	322.794	0,35	Total du portefeuille		90.279.740	98,08
				Autres éléments de l'actif net		1.767.431	1,92
				Total de l'actif net (USD)		92.047.171	100,00

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	50.000	USD	54.974	Barclays	5/9/2023	(725)
EUR	390.000	USD	426.006	Standard Chartered Bank	5/9/2023	(2.856)
EUR	183.000	USD	202.104	Westpac	5/9/2023	(3.549)
GBP	14.000	USD	17.879	Morgan Stanley	5/9/2023	(132)
USD	1.920.414	GBP	1.492.500	Royal Bank of Canada	5/9/2023	28.438
USD	805.428	CAD	1.065.000	JP Morgan	5/9/2023	18.193
USD	13.646.477	EUR	12.344.000	BNP Paribas	5/9/2023	253.265
USD	98.624	EUR	90.000	JP Morgan	5/9/2023	974
USD	19.088	GBP	15.000	JP Morgan	5/9/2023	73
USD	217.850	EUR	200.000	State Street	5/9/2023	851
USD	70.169	EUR	65.000	Standard Chartered Bank	5/9/2023	(356)
USD	59.672	EUR	55.000	Royal Bank of Canada	5/9/2023	(3)
						294.173
						Plus-value nette non réalisée
						294.173
						Catégorie d'Actions couverte en AUD
AUD	114.988.478	USD	74.880.323	BNY Mellon	15/9/2023	(366.040)
USD	1.514.449	AUD	2.347.952	BNY Mellon	15/9/2023	(7.054)
						Moins-value nette non réalisée
						(373.094)
						Catégorie d'Actions couverte en EUR
EUR	13.038.527	USD	14.304.734	BNY Mellon	15/9/2023	(151.031)
USD	384.794	EUR	352.154	BNY Mellon	15/9/2023	2.522
						Moins-value nette non réalisée
						(148.509)
						Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 107.762.416)
						(227.430)

(4) Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund⁽⁴⁾ suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(1)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	144.298	(1.964)
(4)	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	503.545	5.164
7	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	881.203	(9.189)
2	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	288.595	(4.318)
(12)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	1.330.687	(6.328)
(1)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	129.469	(1.776)
1	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	120.845	482
1	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	120.845	482
1	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	121.563	1.284
(3)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	332.672	(1.582)
4	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	814.688	1.056
31	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	3.310.945	14.893
(8)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	854.437	(3.510)
(5)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	579.922	(5.356)
(2)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	258.938	(3.552)
Total				9.792.652	(14.214)

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				EUR 1.500.000	Republic of Austria Government Bond 2,9% 20/2/2033	1.477.800	0,08
OBLIGATIONS				EUR 8.241.000	Republic of Austria Government Bond 4,15% 15/3/2037	9.050.943	0,46
Australie				EUR 200.000	UniCredit Bank Austria 0,625% 20/3/2029	172.566	0,01
EUR 2.726.000	APA Infrastructure 2% 15/7/2030	2.334.124	0,12	45.645.375 2,35			
EUR 250.000	Australia & New Zealand Banking 0,45% 22/11/2023	248.240	0,01	Belgique			
EUR 429.000	Commonwealth Bank of Australia 0,5% 27/7/2026	391.786	0,02	EUR 200.000	Argenta Spaarbank 0,01% 11/2/2031*	155.607	0,01
EUR 750.000	Commonwealth Bank of Australia 0,75% 28/2/2028	663.454	0,03	EUR 3.300.000	Argenta Spaarbank 5,375% 29/11/2027	3.342.075	0,17
EUR 550.000	Commonwealth Bank of Australia 3,768% 31/8/2027	553.201	0,03	EUR 200.000	Belfius Bank 0,125% 14/9/2026	181.041	0,01
EUR 690.000	Westpac Banking 3,106% 23/11/2027*	675.727	0,04	EUR 100.000	Belfius Bank 1% 12/6/2028	89.753	0,00
4.866.532 0,25				EUR 9.400.000	BNP Paribas Fortis 0% 24/10/2023	9.351.308	0,48
Autriche				EUR 400.000	BNP Paribas Fortis 0,875% 22/3/2028	358.590	0,02
EUR 600.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 0,25% 12/1/2032	464.298	0,03	EUR 5.200.000	Fluxys Belgium 1,75% 5/10/2027	4.709.484	0,24
EUR 700.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 0,75% 18/1/2027	639.819	0,03	EUR 200.000	ING Belgium 0,75% 28/9/2026	184.267	0,01
EUR 2.900.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 2% 25/8/2032	2.579.695	0,13	EUR 200.000	KBC 0,75% 24/1/2030	163.092	0,01
EUR 400.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 3,125% 12/1/2029	394.537	0,02	EUR 200.000	KBC 4,375% 6/12/2031	199.549	0,01
EUR 2.500.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 4,125% 18/1/2027	2.467.450	0,13	EUR 200.000	KBC Bank 0% 3/12/2025	184.734	0,01
EUR 800.000	Erste Bank 0,01% 11/9/2029	655.332	0,03	EUR 8.819.074	Kingdom of Belgium Government Bond 0,5% 22/10/2024*	8.540.391	0,44
EUR 200.000	Erste Bank 0,1% 15/1/2030	162.929	0,01	EUR 7.980.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,8% 22/6/2025	7.660.162	0,39
EUR 3.800.000	Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien 1,25% 21/4/2027	3.506.051	0,18	EUR 11.805.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,8% 22/6/2027*	10.925.528	0,56
EUR 5.500.000	Republic of Austria Government Bond 0% 20/10/2028	4.737.563	0,24	EUR 3.415.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,8% 22/6/2028	3.110.783	0,16
EUR 7.555.000	Republic of Austria Government Bond 0,5% 20/4/2027*	6.925.820	0,36	EUR 29.825.000	Kingdom of Belgium Government Bond 1,25% 22/4/2033*	25.526.472	1,31
EUR 2.367.000	Republic of Austria Government Bond 0,9% 20/2/2032	1.991.712	0,10	EUR 11.477.366	Kingdom of Belgium Government Bond 2,75% 22/4/2039	10.601.761	0,54
EUR 4.900.000	Republic of Austria Government Bond 1,65% 21/10/2024	4.803.550	0,25	EUR 1.854.000	Kingdom of Belgium Government Bond 3,3% 22/6/2054	1.758.009	0,09
EUR 4.446.000	Republic of Austria Government Bond 1,85% 23/5/2049	3.365.844	0,17	87.042.606 4,46			
EUR 3.301.000	Republic of Austria Government Bond 2,1% 20/9/2117	2.249.466	0,12	Canada			
				EUR 661.000	Bank of Montreal 1% 5/4/2026	616.868	0,03
				EUR 460.000	Bank of Montreal 3,375% 4/7/2026*	455.984	0,02
				EUR 4.878.000	Bank of Nova Scotia/The 0,01% 14/9/2029	3.958.229	0,20
				EUR 100.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 0,04% 9/7/2027	87.455	0,00
				EUR 9.268.000	CPPIB Capital 0,375% 20/6/2024	9.017.857	0,46
				EUR 8.982.000	CPPIB Capital 0,875% 6/2/2029	7.901.928	0,41
				EUR 700.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 3,25% 18/4/2028	690.844	0,04
				EUR 600.000	HSBC Bank Canada 3,625% 7/3/2028	602.475	0,03
				EUR 484.000	National Bank of Canada 0,75% 13/3/2025	462.189	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 100.000	Caisse Francaise de Financement Local 0,75% 11/1/2027	91.551	0,01	EUR 17.800.000	Dexia Credit Local 0,625% 17/1/2026	16.646.382	0,85
EUR 3.400.000	Caisse Francaise de Financement Local 1,125% 9/9/2025*	3.236.035	0,17	EUR 100.000	Electricite de France 5% 22/1/2026	95.850	0,01
EUR 200.000	Caisse Francaise de Financement Local 1,125% 1/12/2031*	168.569	0,01	EUR 15.536	FCT Autonoria 2019 4,842% 25/9/2035	15.484	0,00
EUR 400.000	Caisse Francaise de Financement Local 1,25% 11/5/2032	336.518	0,02	EUR 15.560	FCT Autonoria 2019 5,242% 25/9/2035	15.498	0,00
EUR 300.000	Caisse Francaise de Financement Local 1,45% 16/1/2034	249.115	0,01	EUR 15.513	FCT Autonoria 2019 6,342% 25/9/2035	15.429	0,00
EUR 400.000	Caisse Francaise de Financement Local 2,875% 30/1/2030	389.635	0,02	EUR 31.073	FCT Autonoria 2019 7,342% 25/9/2035	30.839	0,00
EUR 200.000	Cie de Financement Foncier 0,05% 16/4/2024	195.477	0,01	EUR 415.882	FCT Noria 2021 4,742% 25/10/2049	409.071	0,02
EUR 400.000	Cie de Financement Foncier 0,375% 11/12/2024	383.248	0,02	EUR 22.251.945	French Republic Government Bond OAT 0% 25/2/2027*	20.126.884	1,03
EUR 3.800.000	Cie de Financement Foncier 0,75% 29/5/2026	3.528.129	0,18	EUR 8.200.000	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/5/2025	7.835.879	0,40
EUR 1.000.000	Cie de Financement Foncier 0,75% 11/1/2028*	894.935	0,05	EUR 17.741.741	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/5/2040*†	11.329.876	0,58
EUR 400.000	Cie de Financement Foncier 0,875% 11/9/2028	354.596	0,02	EUR 12.403.484	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/6/2044	7.195.496	0,37
EUR 6.500.000	Cie de Financement Foncier 1,125% 24/6/2025	6.212.009	0,32	EUR 26.730.000	French Republic Government Bond OAT 0,75% 25/2/2028*	24.407.564	1,25
EUR 300.000	Cie de Financement Foncier 1,25% 15/11/2032	251.027	0,01	EUR 1.100.000	French Republic Government Bond OAT 1,25% 25/5/2038	841.123	0,04
EUR 1.700.000	Cie de Saint-Gobain 0,625% 15/3/2024	1.670.335	0,09	EUR 18.125.000	French Republic Government Bond OAT 2,25% 25/5/2024*	17.946.469	0,92
EUR 2.200.000	Cie de Saint-Gobain 0,875% 21/9/2023	2.196.843	0,11	EUR 2.540.000	French Republic Government Bond OAT 2,5% 25/5/2043	2.217.130	0,11
EUR 4.800.000	Credit Agricole 4% 18/1/2033*	4.778.669	0,25	EUR 8.890.000	French Republic Government Bond OAT 2,75% 25/2/2029	8.831.326	0,45
EUR 7.200.000	Credit Agricole 4,125% 7/3/2030	7.264.714	0,37	EUR 27.160.000	French Republic Government Bond OAT 3% 25/5/2054*†	24.693.962	1,27
EUR 1.100.000	Credit Agricole Home Loan SFH 0,25% 23/2/2024	1.081.762	0,06	EUR 1.000.000	Ginkgo Auto Loans 2022 4,342% 25/7/2043	1.002.612	0,05
EUR 600.000	Credit Agricole Home Loan SFH 0,5% 3/4/2025*	570.747	0,03	EUR 910.593	Ginkgo Sales Finance 2022 4,342% 25/11/2049	911.731	0,05
EUR 300.000	Credit Agricole Home Loan SFH 1% 16/1/2029	265.614	0,01	EUR 1.048.562	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 4,484% 27/8/2061	1.053.152	0,05
EUR 1.000.000	Credit Agricole Home Loan SFH 2,875% 23/6/2028*	977.995	0,05	EUR 600.000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 4,734% 27/5/2061	590.137	0,03
EUR 500.000	Credit Agricole Home Loan SFH 3,125% 16/8/2029*	494.528	0,03	EUR 4.500.000	La Banque Postale 4,375% 17/1/2030	4.443.660	0,23
EUR 700.000	Credit Agricole Home Loan SFH 3,125% 18/10/2030	688.796	0,04	EUR 300.000	La Banque Postale Home Loan SFH 3% 31/1/2031*	293.873	0,02
EUR 300.000	Credit Agricole Home Loan SFH 3,25% 28/9/2032	297.531	0,02	EUR 7.700.000	La Banque Postale Home Loan SFH 3,125% 19/2/2029	7.604.443	0,39
EUR 200.000	Credit Agricole Home Loan SFH 3,25% 8/6/2033	197.592	0,01	EUR 800.000	Orange 2,375% 15/1/2025	764.520	0,04
EUR 300.000	Credit Agricole Public Sector SCF 0,01% 13/9/2028*	254.291	0,01	EUR 3.000.000	Societe Generale 4,125% 2/6/2027	3.000.760	0,15
EUR 300.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 0,125% 9/4/2025*	283.341	0,01	EUR 800.000	Societe Generale 4,25% 6/12/2030	776.600	0,04
EUR 200.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 0,125% 28/1/2030	163.146	0,01	EUR 2.600.000	Societe Generale 5,625% 2/6/2033	2.577.076	0,13
EUR 800.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 0,625% 8/12/2027	726.500	0,04	EUR 300.000	Societe Generale SFH 0,01% 2/12/2026	269.037	0,01
EUR 700.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 2,375% 8/2/2028*	671.212	0,03	EUR 300.000	Societe Generale SFH 0,01% 11/2/2030	243.086	0,01
EUR 700.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 2,75% 8/12/2027*	681.663	0,04	EUR 100.000	Societe Generale SFH 0,125% 18/7/2029	83.216	0,00
EUR 10.800.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 3,25% 20/4/2029	10.719.432	0,55	EUR 500.000	Societe Generale SFH 0,5% 2/6/2025	473.368	0,02
				EUR 100.000	Societe Generale SFH 0,5% 28/1/2026	93.016	0,00
				EUR 200.000	Societe Generale SFH 0,75% 29/1/2027	182.844	0,01

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 10.100.000	Societe Generale SFH 3,125% 24/2/2032	9.937.592	0,51	EUR 200.000	Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale 0,01% 26/9/2029	165.425	0,01
EUR 3.946.000	TotalEnergies 2% 17/1/2027	3.467.141	0,18	EUR 125.000	Muenchener Hypothekenbank eG 0,01% 2/11/2040	70.894	0,00
EUR 3.500.000	TotalEnergies Capital International 0,696% 31/5/2028	3.080.799	0,16	EUR 250.000	Muenchener Hypothekenbank eG 2,5% 4/7/2028	241.706	0,01
EUR 15.000.000	UNEDIC ASSEO 0,875% 25/5/2028	13.525.575	0,69	EUR 334.000	Norddeutsche Landesbank-Girozentrale 0,625% 18/1/2027	305.066	0,02
EUR 5.000.000	Veolia Environnement 0,892% 14/1/2024	4.941.975	0,25	EUR 6.035.000	NRW Bank 0,1% 9/7/2035	4.179.207	0,21
EUR 4.900.000	Veolia Environnement 2,25% 20/1/2026	4.461.450	0,23	EUR 6.057.000	NRW Bank 0,375% 16/5/2029	5.209.065	0,27
EUR 2.500.000	Veolia Environnement 2,5% 20/1/2029	2.082.500	0,11	EUR 354.000	NRW Bank 0,5% 17/6/2041	220.916	0,01
		432.742.485	22,22	EUR 8.915.000	NRW Bank 0,625% 2/2/2029	7.825.899	0,40
				EUR 37.231	Red & Black Auto Germany 6 UG 5,038% 15/10/2028	37.174	0,00
	Allemagne			EUR 389.538	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,388% 15/9/2030	387.755	0,02
EUR 3.500.000	Allianz 4,597% 7/9/2038	3.427.900	0,18	EUR 233.723	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,588% 15/9/2030	230.022	0,01
EUR 2.800.000	Allianz 5,824% 25/7/2053	2.895.676	0,15	EUR 77.908	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,988% 15/9/2030	76.065	0,00
EUR 6.200.000	Bayer 2,375% 12/11/2079	5.788.804	0,29	EUR 4.500.000	Robert Bosch 4,375% 2/6/2043	4.498.740	0,23
EUR 10.348.000	Bayer 4,625% 26/5/2033	10.487.025	0,54	EUR 2.475.000	RWE 2,75% 24/5/2030	2.291.825	0,12
EUR 4.800.000	Bayerische Landesbank 1,375% 22/11/2032	3.840.794	0,20	EUR 100.000	Santander Consumer Bank 0,05% 14/2/2030	82.068	0,00
EUR 150.000	Berlin Hyp 0,01% 24/1/2028	130.496	0,01	EUR 8.450.000	State of Hesse 0,375% 6/7/2026	7.798.547	0,40
EUR 7.363.994	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1% 15/5/2038*	5.914.757	0,30	EUR 4.820.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0,5% 15/1/2052	2.331.844	0,12
EUR 10.655.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,8% 15/8/2053*	8.898.813	0,46	EUR 11.207.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0,6% 4/6/2041	7.089.755	0,37
EUR 8.100.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,75% 4/7/2040*	10.397.237	0,53	EUR 1.000.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 1% 16/1/2025	966.220	0,05
EUR 158.000	Commerzbank 0,125% 15/12/2026	142.352	0,01	EUR 5.500.000	Volkswagen Bank 1,25% 10/6/2024	5.378.725	0,28
EUR 600.000	Commerzbank 0,5% 9/6/2026*	553.656	0,03	EUR 4.990.000	Volkswagen Financial Services 1,5% 1/10/2024	4.859.262	0,25
EUR 121.000	Commerzbank 0,5% 15/3/2027	109.601	0,00	EUR 2.700.000	Vonovia 2,375% 25/3/2032	2.193.137	0,11
EUR 2.500.000	Commerzbank 5,125% 18/1/2030	2.482.113	0,13			160.446.205	8,24
EUR 9.200.000	Deutsche Bank 5% 5/9/2030	8.949.760	0,46		Grèce		
EUR 175.000	DZ HYP 0,01% 15/1/2027*	156.474	0,01	EUR 1.499.000	Hellenic Republic Government Bond 4,375% 18/7/2038	1.553.316	0,08
EUR 300.000	DZ HYP 0,1% 31/8/2026	272.077	0,01		International		
EUR 445.000	DZ HYP 0,5% 30/9/2026*	407.974	0,02	EUR 7.180.000	African Development Bank 0,5% 21/3/2029	6.226.209	0,32
EUR 100.000	DZ HYP 0,875% 30/1/2029	88.459	0,00	EUR 1.301.000	European Investment Bank 0% 17/6/2027	1.160.570	0,06
EUR 1.500.000	Eurogrid 1,5% 18/4/2028	1.362.008	0,07	EUR 1.122.000	European Investment Bank 0,1% 15/10/2026	1.023.881	0,05
EUR 200.000	FCT Autonoria DE 2023 4,792% 26/1/2043	199.678	0,01	EUR 2.838.000	European Investment Bank 0,2% 17/3/2036	1.955.126	0,10
EUR 200.000	FCT Autonoria DE 2023 5,742% 26/1/2043	199.485	0,01	EUR 17.060.000	European Investment Bank 0,25% 15/6/2040*	10.365.592	0,53
EUR 100.000	FCT Autonoria DE 2023 6,692% 26/1/2043	99.614	0,01	EUR 1.618.000	European Investment Bank 0,375% 15/5/2026	1.504.012	0,08
EUR 100.000	FCT Autonoria DE 2023 9,142% 26/1/2043	99.707	0,01	EUR 10.377.000	European Investment Bank 0,5% 13/11/2037*	7.168.727	0,37
EUR 10.935.000	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 0,625% 13/2/2029	9.613.778	0,49	EUR 900.000	European Investment Bank 0,875% 14/1/2028	822.465	0,04
EUR 6.000.000	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 0,75% 25/9/2028*	5.365.261	0,28	EUR 1.200.000	European Investment Bank 1,5% 15/6/2032*	1.058.730	0,06
EUR 400.000	ING-DiBa 0,01% 7/10/2028	340.288	0,02	EUR 6.137.000	European Investment Bank 3% 15/7/2033*	6.094.839	0,31
EUR 1.512.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0% 30/9/2026	1.375.277	0,07				
EUR 2.181.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125% 4/10/2024	2.105.298	0,11				
EUR 18.216.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,125% 10/10/2028	18.302.526	0,94				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 249.000	European Stability Mechanism 0,75% 5/9/2028	222.847	0,01	GBP 759.838	Taurus 2019-2 UK 7,438% 17/11/2029	849.853	0,04
EUR 4.300.000	European Stability Mechanism 1,85% 1/12/2055	2.967.854	0,15	GBP 219.389	Taurus 2021-1 UK 6,519% 17/5/2031	242.145	0,01
EUR 4.473.000	European Union 0% 4/7/2035	3.073.197	0,16	GBP 358.368	Taurus 2021-1 UK 6,869% 17/5/2031	387.729	0,02
EUR 5.145.023	European Union 0,45% 4/7/2041	3.137.306	0,16	GBP 194.571	Taurus 2021-1 UK 7,819% 17/5/2031	218.102	0,01
EUR 6.500.000	European Union 0,7% 6/7/2051	3.471.523	0,18	GBP 195.739	Taurus 2021-4 UK 7,319% 17/8/2031	210.153	0,01
EUR 12.626.000	European Union 2,5% 4/10/2052	10.500.097	0,54	EUR 825.812	Vita Scientia 2022-1 5,084% 27/2/2033	793.998	0,04
EUR 9.369.000	European Union 3,375% 4/11/2042	9.293.827	0,48			39.702.518	2,04
		70.046.802	3,60				
	Irlande				Italie		
GBP 973.636	Agora UK 2021 6,37% 22/7/2031	1.094.937	0,06	EUR 2.180.000	A2A 4,375% 3/2/2034*	2.153.001	0,11
GBP 434.262	Atom Mortgage 7,07% 22/7/2031	426.949	0,02	EUR 74.717	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen 4,888% 15/4/2032	74.614	0,00
EUR 350.000	Avoca CLO XIV 0% 12/1/2031	146.835	0,01	EUR 24.102	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen 5,438% 15/4/2032	24.077	0,00
EUR 100.000	Avoca CLO XIV 8,361% 12/1/2031	95.181	0,00	EUR 24.102	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen 6,488% 15/4/2032	24.196	0,00
EUR 100.000	Avoca CLO XIV 10,011% 12/1/2031	88.084	0,00	EUR 24.102	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen 7,488% 15/4/2032	24.252	0,00
EUR 8.480.000	Bank of Ireland Mortgage Bank 0,625% 14/3/2025	8.083.687	0,42	EUR 128.188	AutoFlorence 1 5,042% 25/12/2042	128.080	0,01
EUR 1.507.564	Haus European Loan Conduit No 39 4,364% 28/7/2051	1.420.584	0,07	EUR 587.151	AutoFlorence 2 4,387% 24/12/2044	577.502	0,03
EUR 1.038.700	Haus European Loan Conduit No 39 4,814% 28/7/2051	929.736	0,05	EUR 227.530	AutoFlorence 2 4,787% 24/12/2044	221.224	0,01
EUR 548.841	Haus European Loan Conduit No 39 5,114% 28/7/2051	452.626	0,02	EUR 153.531	AutoFlorence 2 5,987% 24/12/2044	150.498	0,01
EUR 2.560.000	Ireland Government Bond 1,3% 15/5/2033	2.207.706	0,11	EUR 171.000	AutoFlorence 3 5,992% 25/12/2046	171.382	0,01
EUR 5.328.170	Ireland Government Bond 1,7% 15/5/2037	4.433.037	0,23	EUR 107.000	AutoFlorence 3 6,992% 25/12/2046	107.345	0,00
EUR 1.891.000	Ireland Government Bond 3% 18/10/2043	1.819.047	0,09	EUR 110.000	AutoFlorence 3 8,992% 25/12/2046	110.573	0,01
EUR 573.404	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,187% 17/8/2033	536.764	0,03	EUR 5.431.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 0,875% 8/10/2026	4.907.153	0,25
EUR 300.448	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,687% 17/8/2033	272.344	0,01	EUR 4.645.000	Banco BPM 3,75% 27/6/2028	4.647.090	0,24
EUR 1.987.582	Last Mile PE 2021 4,837% 17/8/2031	1.887.580	0,10	EUR 143.000	Brignole 2021 4,437% 24/7/2036	142.070	0,01
EUR 666.860	Last Mile PE 2021 4,987% 17/8/2031	626.683	0,03	EUR 100.000	Brignole 2021 5,237% 24/7/2036	98.285	0,00
EUR 601.874	Last Mile PE 2021 5,387% 17/8/2031	554.662	0,03	EUR 400.000	Credit Agricole Italia 0,125% 15/3/2033*	284.206	0,01
EUR 3.300.000	Linde 3,375% 12/6/2029	3.283.797	0,17	EUR 100.000	Credit Agricole Italia 1% 25/3/2027	91.070	0,00
EUR 1.094.671	Lt Autorahoitus IV 4,313% 18/7/2033	1.096.672	0,06	EUR 200.000	Credit Agricole Italia 1% 17/1/2045	116.043	0,01
EUR 1.888.107	Pearl Finance 2020 5,187% 17/11/2032	1.857.614	0,10	EUR 10.145.000	Credito Emiliano 1,125% 17/1/2024	10.034.474	0,52
EUR 1.128.144	Pearl Finance 2020 5,687% 17/11/2032	1.104.986	0,06	EUR 1.186.000	Enel 6,625% 16/4/2031	1.212.389	0,06
EUR 967.655	Pearl Finance 2020 6,287% 17/11/2032	942.254	0,05	EUR 6.139.000	Eni 2,625% 13/10/2025	5.706.246	0,29
EUR 429.425	River Green Finance 2020 4,748% 22/1/2032	407.284	0,02	EUR 7.300.000	Intesa Sanpaolo 0,5% 5/3/2024	7.173.929	0,37
EUR 221.950	River Green Finance 2020 5,098% 22/1/2032	210.238	0,01	EUR 500.000	Intesa Sanpaolo 1% 25/9/2025	472.698	0,02
EUR 345.330	SCF Rahoituspalvelut IX 4,622% 25/10/2030	343.487	0,02	EUR 6.490.000	Intesa Sanpaolo 3,625% 30/6/2028	6.480.622	0,33
GBP 1.424.697	Taurus 2019-2 UK 6,538% 17/11/2029	1.637.790	0,09	EUR 16.300.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,1% 1/4/2027	14.990.333	0,77
GBP 916.555	Taurus 2019-2 UK 7,138% 17/11/2029	1.039.974	0,05	EUR 1.300.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,65% 1/12/2027	1.254.391	0,06
				EUR 12.279.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,4% 1/4/2028	12.174.822	0,63

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 40.105.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4% 30/4/2035*	39.425.084	2,02	EUR 519.965	Germany Compartment Consumer 2020-1 4,771% 14/11/2034	519.731	0,03
EUR 4.240.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,45% 1/9/2043	4.227.621	0,22	EUR 5.181.000	Medtronic Global 0,25% 2/7/2025	4.857.291	0,25
EUR 10.805.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,5% 1/10/2053	10.690.161	0,55	EUR 2.458.000	SELP Finance 3,75% 10/8/2027	2.325.723	0,12
EUR 14.860.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,75% 1/9/2044	15.430.267	0,79	EUR 851.000	State of the Grand-Duchy of Luxembourg 3% 2/3/2033	851.289	0,04
EUR 4.410.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5% 1/8/2039	4.725.844	0,24	EUR 936.000	State of the Grand-Duchy of Luxembourg 3,25% 2/3/2043	934.320	0,05
EUR 2.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5% 1/9/2040	2.145.225	0,11	EUR 4.000.000	Traton Finance Luxembourg 4,125% 22/11/2025	3.974.960	0,20
EUR 5.545.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario 0,5% 1/10/2026	5.034.056	0,26			50.569.728	2,60
EUR 368.534	Progetto Quinto 4,23% 27/10/2036	368.102	0,02		Monténégro		
EUR 3.606.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 3,625% 21/4/2029	3.559.799	0,19	EUR 3.834.000	Montenegro Government International Bond 2,875% 16/12/2027	3.307.458	0,17
EUR 10.970.000	UniCredit 3,5% 31/7/2030	10.874.835	0,56		Pays-Bas		
		170.033.559	8,72	EUR 200.000	ABN AMRO Bank 0,375% 14/1/2035	144.608	0,01
	Japon			EUR 300.000	ABN AMRO Bank 0,4% 17/9/2041	177.839	0,01
EUR 5.100.000	Sumitomo Mitsui Banking 0,01% 10/9/2025	4.709.213	0,24	EUR 400.000	ABN AMRO Bank 0,875% 14/1/2026	376.375	0,02
EUR 4.525.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank 3,629% 6/4/2026	4.493.153	0,23	EUR 100.000	ABN AMRO Bank 1% 13/4/2031	85.141	0,00
		9.202.366	0,47	EUR 200.000	ABN AMRO Bank 1,125% 12/1/2032	169.432	0,01
	Lettonie			EUR 300.000	ABN AMRO Bank 1,375% 10/1/2034	249.594	0,01
EUR 1.625.000	Latvia Government International Bond 3,5% 17/1/2028	1.610.513	0,08	EUR 200.000	ABN AMRO Bank 1,45% 12/4/2038	156.214	0,01
EUR 2.050.000	Latvia Government International Bond 3,875% 12/7/2033	2.046.433	0,11	EUR 600.000	ABN AMRO Bank 1,5% 30/9/2030	535.389	0,03
		3.656.946	0,19	EUR 4.100.000	ABN AMRO Bank 4,375% 20/10/2028	4.098.175	0,21
	Lituanie			EUR 4.900.000	ABN AMRO Bank 5,125% 22/2/2033	4.819.150	0,25
EUR 3.300.000	Lithuania Government International Bond 2,125% 1/6/2032*	2.884.150	0,15	EUR 3.000.000	Achmea Bank 0,01% 16/6/2025	2.809.260	0,14
	Luxembourg			EUR 5.900.000	Aegon Bank 0,01% 16/11/2025	5.447.588	0,28
EUR 646.000	BL Consumer Credit 2021 4,392% 25/9/2038	646.725	0,03	EUR 300.000	Aegon Bank 0,375% 9/6/2036	207.333	0,01
EUR 355.000	BL Consumer Credit 2021 6,492% 25/9/2038	349.364	0,02	EUR 5.615.000	BNG Bank 0,125% 19/4/2033	4.226.136	0,22
EUR 1.300.000	Bumper De 4,192% 23/8/2032	1.302.212	0,07	EUR 3.978.000	BNG Bank 0,75% 11/1/2028	3.596.967	0,18
EUR 853.000	European Financial Stability Facility 0% 20/1/2031	682.775	0,03	EUR 2.900.000	BNG Bank 0,805% 28/6/2049	1.578.310	0,08
EUR 820.000	European Financial Stability Facility 0,05% 17/10/2029	684.634	0,04	EUR 7.460.000	BNG Bank 3% 23/4/2030	7.400.022	0,38
EUR 998.000	European Financial Stability Facility 0,7% 20/1/2050	536.475	0,03	EUR 4.945.000	BNG Bank 3,25% 29/8/2033	4.985.574	0,26
EUR 4.206.000	European Financial Stability Facility 0,7% 17/1/2053*	2.128.457	0,11	EUR 731.000	BP Capital Markets 1,467% 21/9/2041	467.935	0,02
EUR 23.260.000	European Financial Stability Facility 0,75% 3/5/2027	21.394.083	1,10	EUR 1.703.000	BP Capital Markets 4,323% 12/5/2035	1.690.036	0,09
EUR 1.205.000	European Financial Stability Facility 0,875% 10/4/2035	934.293	0,05	EUR 300.000	Cooperatieve Rabobank 0,01% 2/7/2030	241.700	0,01
EUR 270.000	European Financial Stability Facility 1,2% 17/2/2045	183.334	0,01	EUR 700.000	Cooperatieve Rabobank 0,75% 21/6/2039	473.936	0,02
EUR 1.678.000	European Financial Stability Facility 1,375% 31/5/2047	1.147.406	0,06	EUR 500.000	Cooperatieve Rabobank 0,875% 8/2/2028	451.195	0,02
EUR 1.900.000	European Financial Stability Facility 1,75% 17/7/2053	1.322.025	0,07	EUR 1.800.000	Cooperatieve Rabobank 4% 10/1/2030	1.779.039	0,09
EUR 7.510.000	European Financial Stability Facility 1,8% 10/7/2048	5.519.212	0,28	EUR 3.600.000	de Volksbank 0,01% 16/9/2024	3.454.119	0,18
EUR 275.000	European Financial Stability Facility 3,375% 30/8/2038	275.419	0,01	EUR 200.000	de Volksbank 0,75% 24/10/2031	164.080	0,01
				EUR 2.700.000	de Volksbank 2,375% 4/5/2027	2.543.079	0,13
				EUR 612.054	Domi 2023-1 4,901% 15/2/2055	616.483	0,03
				EUR 143.000	Domi 2023-1 5,481% 15/2/2055	142.309	0,01
				EUR 778.082	Dutch Property Finance 2020-2 4,504% 28/1/2058	778.008	0,04
				EUR 290.000	Dutch Property Finance 2020-2 5,064% 28/1/2058	289.190	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 939.572	Dutch Property Finance 2021-1 4,364% 28/7/2058	939.359	0,05	EUR 6.207.000	ASB Bank 0,25% 21/5/2031*	4.831.467	0,25
EUR 1.932.290	Dutch Property Finance 2023-1 4,614% 28/4/2064	1.936.926	0,10	EUR 5.745.000	ASB Bank 0,625% 18/10/2024*	5.535.825	0,29
EUR 2.217.000	ELM for Firmenich International 3,75% 3/9/2025	2.138.186	0,11	EUR 7.631.000	Bank of New Zealand 3,708% 20/12/2028*	7.642.904	0,39
EUR 150.000	ELM for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft 3,375% 29/9/2047	137.213	0,01	EUR 4.319.000	Chorus 1,125% 18/10/2023	4.302.674	0,22
EUR 3.742.000	EnBW International Finance 4% 24/1/2035	3.650.845	0,19	EUR 2.662.000	Chorus 3,625% 7/9/2029	2.597.207	0,13
EUR 1.285.000	EnBW International Finance 4,049% 22/11/2029	1.299.482	0,07	NZD 5.719.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,5% 20/9/2040	3.693.889	0,19
EUR 3.928.000	Enexis 3,625% 12/6/2034	3.923.306	0,20	EUR 400.000	Westpac NZ 3,75% 20/4/2028	401.600	0,02
EUR 200.000	ING Bank 0,5% 17/2/2027	181.370	0,01			40.885.497	2,10
EUR 1.100.000	ING Bank 0,75% 18/2/2029	964.117	0,05	Norvège			
EUR 200.000	ING Bank 3% 15/2/2033*	195.633	0,01	EUR 3.817.000	DNB Bank 3,125% 21/9/2027	3.727.301	0,19
EUR 1.700.000	ING Groep 0,25% 18/2/2029	1.409.536	0,07	EUR 865.000	DNB Bank 4,5% 19/7/2028	873.330	0,05
EUR 11.000.000	ING Groep 1,25% 16/2/2027	10.202.500	0,52	EUR 740.000	DNB Boligkreditt 0,01% 12/5/2028	632.799	0,03
EUR 500.000	ING Groep 5% 20/2/2035	487.835	0,03	EUR 275.000	DNB Boligkreditt 0,01% 21/1/2031	215.779	0,01
EUR 50.570	Magoi 2019 4,532% 27/7/2039	50.227	0,01	EUR 400.000	DNB Boligkreditt 0,375% 20/11/2024	383.938	0,02
EUR 25.270	Magoi 2019 4,932% 27/7/2039	24.928	0,00	EUR 425.000	DNB Boligkreditt 0,625% 19/6/2025	402.719	0,02
EUR 25.332	Magoi 2019 5,332% 27/7/2039	24.826	0,00	EUR 300.000	DNB Boligkreditt 0,625% 14/1/2026	279.849	0,01
EUR 25.331	Magoi 2019 6,132% 27/7/2039	25.126	0,00	EUR 2.885.000	Eika Boligkreditt 0,5% 28/8/2025	2.711.741	0,14
EUR 200.000	Nationale-Nederlanden Bank 0,125% 24/9/2029	165.492	0,01	EUR 200.000	Eika Boligkreditt 0,875% 1/2/2029	175.352	0,01
EUR 5.600.000	Nationale-Nederlanden Bank 0,5% 10/10/2024	5.399.576	0,28	EUR 100.000	Eika Boligkreditt 2,5% 22/9/2028	95.939	0,01
EUR 300.000	Nationale-Nederlanden Bank 1% 25/9/2028	268.176	0,01	EUR 325.000	SpareBank 1 Boligkreditt 0,01% 22/9/2027	283.208	0,01
EUR 700.000	Naturgy Finance 2,374% 23/11/2026	621.950	0,03	EUR 11.460.000	SpareBank 1 Boligkreditt 0,05% 3/11/2028	9.661.238	0,50
EUR 456.315	Netherlands Government Bond 0% 15/7/2030	379.312	0,02	EUR 8.252.000	SpareBank 1 Boligkreditt 0,125% 20/1/2028	7.156.854	0,37
EUR 9.065.000	Netherlands Government Bond 0,5% 15/1/2040	6.256.616	0,32	EUR 4.955.000	SpareBank 1 Boligkreditt 0,5% 30/1/2025	4.735.394	0,24
EUR 19.920.286	Netherlands Government Bond 0,75% 15/7/2027*	18.463.084	0,95	EUR 500.000	SpareBank 1 Boligkreditt 1,75% 25/5/2027	470.354	0,02
EUR 900.000	Netherlands Government Bond 2% 15/1/2054	745.700	0,04	EUR 100.000	SpareBank 1 Boligkreditt 3% 19/5/2030	97.807	0,01
EUR 6.042.301	Netherlands Government Bond 2,75% 15/1/2047*	5.918.087	0,30	EUR 3.451.000	Telenor 0% 25/9/2023	3.441.630	0,17
EUR 2.124.000	RELX Finance 3,75% 12/6/2031	2.117.330	0,11			35.345.232	1,81
EUR 2.268.000	Shell International Finance 1,875% 7/4/2032	1.974.124	0,10	Pologne			
EUR 600.000	Telefonica Europe 3% 2/10/2023	598.380	0,03	EUR 5.015.000	Republic of Poland Government International Bond 0% 10/2/2025*	4.720.219	0,24
EUR 2.249.000	TenneT 4,5% 28/10/2034	2.379.048	0,12	EUR 4.815.000	Republic of Poland Government International Bond 1% 25/10/2028*	4.280.294	0,22
EUR 5.576.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,875% 15/9/2031	5.849.531	0,30	EUR 4.250.000	Republic of Poland Government International Bond 2,75% 25/5/2032	3.889.451	0,20
EUR 1.010.000	Universal Music 3,75% 30/6/2032	984.916	0,05			12.889.964	0,66
EUR 2.866.000	Universal Music 4% 13/6/2031	2.851.599	0,15	Portugal			
EUR 400.000	Van Lanschot Kempen 0,875% 15/2/2027	365.748	0,02	EUR 100.000	Banco BPI 0,25% 22/3/2024	97.969	0,01
EUR 2.700.000	Volkswagen International Finance 3,5% 17/6/2025	2.550.285	0,13	EUR 8.700.000	Banco Santander Totta 3,375% 19/4/2028	8.613.000	0,44
EUR 900.000	Vonovia Finance 2,25% 7/4/2030*	755.041	0,04	EUR 1.100.000	EDP - Energias de Portugal 3,875% 26/6/2028	1.103.514	0,06
		140.389.626	7,21	EUR 10.105.454	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 3,5% 18/6/2038*	10.050.026	0,51
Nouvelle-Zélande				EUR 177.084	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos 0,7% 12/2/2024	175.268	0,01
EUR 5.900.000	ANZ New Zealand Int'l 0,125% 22/9/2023	5.889.409	0,30				
EUR 6.065.000	ANZ New Zealand Int'l 0,5% 17/1/2024	5.990.522	0,31				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 687.541	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Ulisses Finance No. 2 6,462% 23/9/2038	645.326	0,03	EUR 2.700.000	AyT Cedulas Cajas X Fondo de Titulizacion de Activos 3,75% 30/6/2025	2.686.203	0,14
EUR 143.558	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 4,582% 28/10/2040	140.510	0,01	EUR 4.000.000	Banco de Sabadell 0,125% 10/2/2028*	3.439.180	0,18
EUR 502.451	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 5,182% 28/10/2040	482.111	0,02	EUR 6.500.000	Banco de Sabadell 1,75% 30/5/2029*	5.894.154	0,30
		21.307.724	1,09	EUR 600.000	Banco Santander 0,01% 27/2/2025	567.048	0,03
				EUR 200.000	Banco Santander 0,1% 27/2/2032*	150.636	0,01
				EUR 1.200.000	Banco Santander 0,125% 4/6/2030	959.587	0,05
				EUR 5.500.000	Banco Santander 0,875% 9/5/2031*	4.530.377	0,23
				EUR 2.500.000	Banco Santander 1% 7/4/2025*	2.392.142	0,12
				EUR 900.000	Banco Santander 2,375% 8/9/2027	862.429	0,05
				EUR 1.600.000	Banco Santander 3,375% 11/1/2026	1.588.606	0,08
				EUR 1.400.000	Banco Santander 3,375% 11/1/2030	1.387.324	0,07
				EUR 200.000	Bankinter 3,05% 29/5/2028	195.262	0,01
				EUR 852.336	BBVA Consumer Auto 2020-1 FTA 4,455% 20/1/2036	853.658	0,04
				EUR 400.000	CaixaBank 1% 25/9/2025	377.860	0,02
				EUR 500.000	CaixaBank 1,625% 14/7/2032*	429.379	0,02
				EUR 100.000	CaixaBank 4,125% 24/3/2036	104.326	0,01
				EUR 3.200.000	CaixaBank 4,25% 6/9/2030	3.211.097	0,17
				EUR 9.300.000	Caja Rural de Navarra 0,625% 1/12/2023*	9.227.179	0,47
				EUR 2.900.000	Caja Rural de Navarra 0,875% 8/5/2025	2.758.625	0,14
				EUR 200.000	Eurocaja Rural 0,125% 22/9/2031	153.463	0,01
				EUR 194.321	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3,5% 21/3/2033	183.454	0,01
				EUR 466.370	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 4,272% 21/3/2033	466.843	0,02
				EUR 116.593	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5,522% 21/3/2033	114.789	0,01
				EUR 3.800.000	Ibercaja Banco 0,25% 18/10/2023	3.783.949	0,19
				EUR 400.000	Kutxabank 1,25% 22/9/2025	380.194	0,02
				EUR 600.000	Programa Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos 4,25% 10/4/2031	631.166	0,03
				EUR 4.400.000	Santander Consumer Finance 0,375% 27/6/2024	4.268.528	0,22
				EUR 19.237.000	Spain Government Bond 0% 31/1/2027	17.263.765	0,88
				EUR 8.700.000	Spain Government Bond 0% 31/1/2028	7.579.222	0,39
				EUR 740.000	Spain Government Bond 0,25% 30/7/2024	717.407	0,04
				EUR 23.410.000	Spain Government Bond 0,8% 30/7/2029	20.392.919	1,05
				EUR 4.034.000	Spain Government Bond 1% 30/7/2042	2.476.956	0,13
				EUR 3.491.000	Spain Government Bond 1,9% 31/10/2052*	2.219.892	0,11
				EUR 11.196.000	Spain Government Bond 1,95% 30/4/2026	10.835.334	0,56
				EUR 21.011.000	Spain Government Bond 2,75% 31/10/2024*	20.828.407	1,07
Singapour							
USD 3.583.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	3.309.317	0,17				
EUR 325.000	United Overseas Bank 0,01% 1/12/2027	280.889	0,01				
		3.590.206	0,18				
Slovaquie							
EUR 4.500.000	Slovakia Government Bond 1% 14/5/2032*	3.625.920	0,19				
EUR 2.000.000	Slovakia Government Bond 2% 17/10/2047	1.387.630	0,07				
EUR 700.000	Slovakia Government Bond 3,625% 8/6/2033	696.500	0,04				
EUR 2.640.000	Slovakia Government Bond 4% 23/2/2043	2.597.575	0,13				
EUR 6.100.000	Vseobecna Uverova Banka 0,01% 23/6/2025	5.674.745	0,29				
EUR 4.600.000	Vseobecna Uverova Banka 0,25% 26/3/2024*	4.495.350	0,23				
		18.477.720	0,95				
Slovénie							
EUR 2.630.000	Slovenia Government Bond 0,275% 14/1/2030*	2.158.047	0,11				
EUR 3.290.000	Slovenia Government Bond 0,488% 20/10/2050	1.502.691	0,08				
		3.660.738	0,19				
Espagne							
EUR 6.800.000	Adif Alta Velocidad 1,25% 4/5/2026*	6.406.994	0,33				
EUR 3.700.000	Adif Alta Velocidad 3,9% 30/4/2033	3.727.254	0,19				
EUR 51.734	Autonomia Spain 2019 4,592% 27/12/2035	51.448	0,00				
EUR 25.867	Autonomia Spain 2019 4,992% 27/12/2035	25.674	0,00				
EUR 25.867	Autonomia Spain 2019 5,492% 27/12/2035	25.620	0,00				
EUR 25.867	Autonomia Spain 2019 6,492% 27/12/2035	25.423	0,00				
EUR 25.867	Autonomia Spain 2019 7,642% 27/12/2035	25.277	0,00				
EUR 671.592	Autonomia Spain 2021 FT 4,442% 31/1/2039	663.392	0,03				
EUR 183.162	Autonomia Spain 2021 FT 5,192% 31/1/2039	178.659	0,01				
EUR 183.162	Autonomia Spain 2021 FT 6,292% 31/1/2039	176.929	0,01				
EUR 122.108	Autonomia Spain 2021 FT 7,542% 31/1/2039	117.031	0,01				
EUR 87.017	Autonomia Spain 2022 FT 5,642% 26/1/2040	87.622	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
GBP 120.000	London Cards NO 1 8,945% 15/5/2033	139.796	0,01	GBP 157.000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6,087% 12/7/2063	179.590	0,01
GBP 448.213	London Wall Mortgage Capital 5,968% 15/5/2051	520.233	0,03	GBP 107.000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6,387% 12/7/2063	120.696	0,01
GBP 110.000	Mortimer BTL 2021-1 6,483% 23/6/2053	124.079	0,01	GBP 381.999	Tower Bridge Funding 2021-1 6,664% 21/7/2064	445.811	0,02
EUR 1.480.000	National Grid 0,75% 1/9/2033	1.055.268	0,05	GBP 252.000	Tower Bridge Funding 2021-1 7,314% 21/7/2064	291.716	0,01
EUR 2.050.000	National Grid 2,949% 30/3/2030	1.904.839	0,10	GBP 252.999	Tower Bridge Funding 2021-2 6,318% 20/11/2063	292.279	0,01
EUR 500.000	National Westminster Bank 0,5% 15/5/2024	488.207	0,03	GBP 139.999	Tower Bridge Funding 2021-2 6,718% 20/11/2063	160.029	0,01
EUR 853.000	Nationwide Building Society 2,25% 25/6/2029	802.407	0,04	GBP 168.999	Tower Bridge Funding 2021-2 7,018% 20/11/2063	188.405	0,01
EUR 316.000	Nationwide Building Society 2,25% 16/5/2037	274.068	0,01	GBP 331.000	Tower Bridge Funding 2022-1 6,025% 20/12/2063	379.586	0,02
EUR 375.000	Nationwide Building Society 3,625% 15/3/2028	377.554	0,02	GBP 195.000	Tower Bridge Funding 2022-1 6,275% 20/12/2063	219.480	0,01
GBP 775.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6,165% 15/3/2029	905.251	0,05	GBP 1.889.533	Tower Bridge Funding 2023-1 6,659% 20/10/2064	2.221.956	0,11
GBP 524.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6,745% 15/3/2029	610.479	0,03	GBP 149.000	Tower Bridge Funding 2023-1 7,359% 20/10/2064	174.309	0,01
GBP 307.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6,545% 15/11/2029	354.601	0,02	GBP 114.000	Tower Bridge Funding 2023-1 8,309% 20/10/2064	133.709	0,01
EUR 42.416	Newgate Funding 3,754% 1/12/2050	39.438	0,00	GBP 128.000	Tower Bridge Funding 2023-1 9,459% 20/10/2064	149.270	0,01
GBP 708.023	Parkmore Point RMBS 2022-1 6,673% 25/7/2045	820.254	0,04	GBP 100.000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	117.199	0,01
GBP 236.000	Polaris 2023-1 8,847% 23/2/2061	277.183	0,01	GBP 135.000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	158.161	0,01
GBP 177.000	Polaris 2023-1 9,547% 23/2/2061	206.248	0,01	GBP 282.000	Twin Bridges 7,271% 14/6/2055	325.861	0,02
GBP 506.734	Precise Mortgage Funding 2019-1B 6,158% 12/12/2055	593.125	0,03	GBP 271.000	Twin Bridges 8,271% 14/6/2055	316.488	0,02
GBP 110.000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6,646% 16/10/2056	128.136	0,01	GBP 996.000	Twin Bridges 2020-1 6,958% 12/12/2054	1.167.964	0,06
GBP 100.000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6,896% 16/10/2056	116.403	0,01	GBP 225.000	Twin Bridges 2020-1 7,958% 12/12/2054	262.167	0,01
GBP 100.000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 7,146% 16/10/2056	114.637	0,01	GBP 1.155.000	Twin Bridges 2021-1 6,358% 12/3/2055	1.341.832	0,07
GBP 410.000	Residential Mortgage 32 7,225% 20/6/2070	477.391	0,02	GBP 220.000	Twin Bridges 2021-1 7,058% 12/3/2055	249.434	0,01
GBP 1.110.000	Sage AR Funding No 1 6,469% 17/11/2030	1.270.415	0,06	GBP 176.000	Twin Bridges 2021-2 6,108% 12/9/2055	197.084	0,01
GBP 385.000	Sage AR Funding No 1 7,169% 17/11/2030	434.090	0,02	GBP 187.000	Twin Bridges 2021-2 6,458% 12/9/2055	205.086	0,01
GBP 535.000	Sage AR Funding No 1 7,369% 17/11/2030	589.947	0,03	GBP 194.721	Unique Pub Finance 7,395% 28/3/2024	226.274	0,01
EUR 150.000	Santander UK 0,05% 12/1/2027	133.223	0,01	EUR 1.456.000	WPP Finance 2016 1,375% 20/3/2025	1.397.942	0,07
EUR 3.950.000	Santander UK 0,1% 12/5/2024	3.847.636	0,20	EUR 125.000	Yorkshire Building Society 0,01% 13/10/2027	107.947	0,01
EUR 8.204.000	Santander UK 0,603% 13/9/2029	6.662.099	0,34			104.328.266	5,36
EUR 5.438.000	Santander UK 3,53% 25/8/2028	5.202.928	0,27		États-Unis		
EUR 3.052.000	SSE 1,75% 16/4/2030*	2.671.429	0,14	EUR 1.049.000	American Tower 0,875% 21/5/2029	861.486	0,04
EUR 1.018.000	SSE 4% 21/1/2028	941.712	0,05	EUR 743.000	American Tower 0,95% 5/10/2030	588.148	0,03
GBP 388.180	Tesco Property Finance 1 7,623% 13/7/2039	484.582	0,02	EUR 401.000	American Tower 1% 15/1/2032	304.183	0,01
GBP 796.972	Tesco Property Finance 3 5,744% 13/4/2040	866.515	0,04	EUR 1.293.000	AT&T 2,6% 19/5/2038	1.016.039	0,05
GBP 487.371	Tesco Property Finance 4 5,801% 13/10/2040	533.100	0,03	EUR 703.000	AT&T 4,3% 18/11/2034	689.733	0,03
EUR 6.537.000	Thames Water Utilities Finance 4,375% 18/1/2031	6.157.719	0,32	EUR 4.251.000	Bank of America 1,949% 27/10/2026	4.049.391	0,21
				EUR 5.810.000	Bank of America 2,824% 27/4/2033	5.195.695	0,27
				EUR 1.142.000	Booking 0,1% 8/3/2025	1.078.847	0,06
				EUR 3.871.000	Citigroup 1,25% 6/7/2026	3.671.626	0,19

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 4.486.000	Global Payments 4,875% 17/3/2031	4.481.335	0,23	EUR 5.828.000	Verizon Communications 0,375% 22/3/2029	4.801.862	0,25
EUR 7.298.000	Goldman Sachs 0,875% 9/5/2029	6.018.916	0,31	EUR 6.698.000	Verizon Communications 4,75% 31/10/2034	6.969.939	0,36
EUR 4.619.000	International Business Machines 3,75% 6/2/2035	4.508.190	0,23			62.060.691	3,18
EUR 1.311.000	Morgan Stanley 0,497% 7/2/2031	1.029.462	0,05	Total des obligations		1.909.126.626	98,00
EUR 8.881.000	Morgan Stanley 4,656% 2/3/2029	8.978.336	0,46	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		1.909.126.626	98,00
EUR 4.617.000	Morgan Stanley 5,148% 25/1/2034	4.853.667	0,25	Total du portefeuille		1.909.126.626	98,00
USD 1.605.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	1.366.430	0,07	Autres éléments de l'actif net		38.940.500	2,00
EUR 1.650.000	US Bancorp 0,85% 7/6/2024	1.597.406	0,08	Total de l'actif net (EUR)		1.948.067.126	100,00

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
CAD	9.040.000	USD	6.872.591	Bank of America	20/9/2023	(173.877)
EUR	2.275.661	NOK	26.300.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(106)
EUR	3.584.879	NZD	6.310.000	Deutsche Bank	17/10/2023	132.845
EUR	2.616.006	USD	2.940.000	Standard Chartered Bank	17/10/2023	(88.087)
EUR	61.698.125	GBP	52.970.000	JP Morgan	17/10/2023	(70.342)
EUR	203.827	USD	230.000	Nomura	17/10/2023	(7.718)
EUR	1.019.593	GBP	880.000	State Street	17/10/2023	(6.578)
EUR	4.079.681	GBP	3.550.000	Deutsche Bank	17/10/2023	(59.984)
EUR	2.147.901	NOK	24.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	71.155
EUR	1.978.169	HUF	780.000.000	Société Générale	20/9/2023	(64.494)
EUR	1.486.036	HUF	583.000.000	Barclays	20/9/2023	(40.724)
EUR	2.252.102	USD	2.480.000	HSBC Bank	17/10/2023	(28.901)
EUR	628.687	HUF	244.000.000	Citigroup	20/9/2023	(10.300)
EUR	353.799	HUF	137.000.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(4.977)
EUR	1.656.090	HUF	642.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(25.178)
EUR	1.320.280	GBP	1.130.000	Standard Chartered Bank	17/10/2023	2.583
EUR	1.273.400	USD	1.390.000	State Street	17/10/2023	(5.066)
EUR	69.932	GBP	60.000	BNY Mellon	17/10/2023	(34)
GBP	3.580.000	USD	4.592.518	Morgan Stanley	20/9/2023	(49.732)
GBP	3.130.000	USD	4.025.905	Barclays	20/9/2023	(53.298)
GBP	3.099.000	EUR	3.587.158	Barclays	17/10/2023	26.595
GBP	8.220.000	EUR	9.503.948	JP Morgan	17/10/2023	81.417
GBP	4.050.000	EUR	4.709.201	Deutsche Bank	17/10/2023	13.516
GBP	1.281.000	EUR	1.488.132	Standard Chartered Bank	17/10/2023	5.645
HUF	804.000.000	EUR	2.060.767	JP Morgan	20/9/2023	44.747
HUF	2.440.000.000	EUR	6.268.643	Deutsche Bank	20/9/2023	121.226
HUF	834.000.000	EUR	2.096.847	BNP Paribas	20/9/2023	87.231
JPY	2.811.000.000	USD	19.693.772	Bank of America	20/9/2023	(378.927)
JPY	1.341.000.000	USD	9.637.581	BNP Paribas	20/9/2023	(404.183)
JPY	22.000.000	USD	152.014	Morgan Stanley	20/9/2023	(1.015)
NOK	25.100.000	USD	2.338.377	Deutsche Bank	20/9/2023	18.303
NOK	50.300.000	EUR	4.278.541	Goldman Sachs	20/9/2023	73.971
NOK	25.000.000	USD	2.326.328	Goldman Sachs	20/9/2023	20.747
NOK	5.849.000	EUR	507.124	BNY Mellon	17/10/2023	(1.273)
NZD	10.920.000	USD	6.808.948	Morgan Stanley	20/9/2023	(289.226)
NZD	11.190.000	USD	6.955.693	Toronto-Dominion	20/9/2023	(276.476)
NZD	3.540.000	USD	2.173.507	HSBC Bank	20/9/2023	(62.640)
USD	4.705.788	GBP	3.740.000	JP Morgan	20/9/2023	(32.760)

Euro Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
USD	2.312.344	GBP	1.810.000	Morgan Stanley	20/9/2023	16.328
USD	2.428.042	GBP	1.900.000	Bank of America	20/9/2023	17.804
USD	2.071.744	GBP	1.630.000	Barclays	20/9/2023	4.902
USD	4.864.260	NOK	50.100.000	Deutsche Bank	20/9/2023	144.738
USD	4.279.960	JPY	598.000.000	Barclays	20/9/2023	163.862
USD	2.321.334	JPY	318.000.000	BNP Paribas	20/9/2023	128.922
USD	6.955.210	NZD	10.920.000	Morgan Stanley	20/9/2023	423.932
USD	6.858.882	CAD	9.040.000	Morgan Stanley	20/9/2023	161.251
USD	4.596.725	GBP	3.540.000	HSBC Bank	20/9/2023	100.311
USD	2.231.496	NZD	3.600.000	HSBC Bank	20/9/2023	83.181
USD	1.097.139	NZD	1.810.000	Barclays	20/9/2023	18.974
USD	5.621.566	JPY	801.750.000	Bank of America	20/9/2023	112.251
USD	1.869.616	JPY	267.250.000	UBS	20/9/2023	33.513
USD	2.040.000	EUR	1.862.306	Deutsche Bank	17/10/2023	14.003
USD	4.604.086	EUR	4.210.000	Barclays	20/9/2023	30.326
Plus-value nette non réalisée						18.383
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	2.842.922	EUR	2.967.237	BNY Mellon	15/9/2023	1.565
EUR	630.587	CHF	605.749	BNY Mellon	15/9/2023	(1.982)
Moins-value nette non réalisée						(417)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	14.786.594	GBP	12.760.184	BNY Mellon	15/9/2023	(115.267)
GBP	12.966.077	EUR	15.035.944	BNY Mellon	15/9/2023	106.362
Moins-value nette non réalisée						(8.905)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
EUR	730	JPY	115.476	BNY Mellon	15/9/2023	1
JPY	15.763.151	EUR	100.868	BNY Mellon	15/9/2023	(1.337)
Moins-value nette non réalisée						(1.336)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
EUR	19.791	PLN	88.370	BNY Mellon	15/9/2023	40
PLN	1.236.386	EUR	277.443	BNY Mellon	15/9/2023	(1.101)
Moins-value nette non réalisée						(1.061)
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	83.197.440	USD	91.322.048	BNY Mellon	15/9/2023	(930.273)
USD	107.612.924	EUR	97.746.701	BNY Mellon	15/9/2023	1.388.652
Plus-value nette non réalisée						458.379
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 561.613.000)						465.043

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
52	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	6.033.560	18.440
504	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	67.032.000	539.630
210	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	28.026.600	(101.280)
(275)	EUR	Euro Schatz	Septembre 2023	28.901.125	(24.441)
(8)	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	927.280	(15.911)
176	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	22.476.960	306.322
(17)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	15.754.228	155.809
(194)	EUR	3 Month EURIBOR	Septembre 2023	46.652.150	(7.275)
(7)	EUR	3 Month EURIBOR	Septembre 2023	1.683.325	(262)
(8)	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	928.240	(5.980)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Bond Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
7	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	931.000	7.460
1	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	133.460	20
41	EUR	Euro Schatz	Septembre 2023	4.308.895	2.370
(9)	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	1.043.190	(6.700)
(17)	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	2.171.070	9.393
(1)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	926.719	9.207
(5)	EUR	Short-Term Euro-BTP	Septembre 2023	526.300	(1.110)
849	EUR	Short-Term Euro-BTP	Septembre 2023	89.365.740	(204.780)
124	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	12.673.854	105.122
51	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	5.452.075	63.510
(23)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	2.744.638	(40.341)
38	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	4.232.576	36.407
(9)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	1.689.529	(4.035)
138	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	13.585.061	87.468
1	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	111.384	783
4	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	408.834	3.391
4	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	393.770	2.535
2	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	213.807	2.491
Total				359.327.370	938.243

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 51.752.500	Fund receives default protection on ITRAXX.EUR.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(237.185)	(678.902)
CDS	EUR 31.220.000	Fund receives default protection on ITRAXX.FINSR.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(317.417)	(271.605)
IFS	EUR 10.600.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,56%	Goldman Sachs	15/6/2028	8.997	8.997
IFS	EUR 29.250.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,46%	Goldman Sachs	15/7/2028	115.277	115.277
IFS	EUR 10.055.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,435%	Goldman Sachs	15/5/2033	98.244	101.406
IFS	EUR 10.630.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,555%	Goldman Sachs	15/6/2033	(8.020)	(8.020)
IFS	EUR 29.155.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,505%	Goldman Sachs	15/7/2033	(113.841)	(113.841)
IFS	EUR 5.308.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,5737%	Goldman Sachs	15/5/2038	(23.952)	(23.952)
IFS	EUR 10.130.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,60125%	Goldman Sachs	15/5/2043	(107.120)	(100.279)
IRS	KRW 32.495.808.750	Fund receives Fixed 1,632%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	21/9/2023	(27.358)	(27.358)
IRS	BRL 5.820.000	Fund receives Fixed 9,94%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(11.383)	(11.383)
IRS	KRW 38.994.981.250	Fund receives Fixed 1,59%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	21/9/2023	(33.481)	(33.481)
IRS	KRW 15.792.971.800	Fund receives Fixed 1,63%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	21/9/2023	(13.309)	(13.309)
IRS	BRL 7.630.000	Fund receives Fixed 10,11%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(8.298)	(8.298)
IRS	GBP 35.350.000	Fund receives Fixed 5,795%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Goldman Sachs	17/8/2025	207.808	207.808
IRS	KRW 14.971.290.000	Fund receives Fixed 3,645%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Goldman Sachs	25/8/2026	13.569	13.569
IRS	EUR 10.015.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 3,109%	Goldman Sachs	28/6/2032	(43.598)	(43.598)
IRS	EUR 2.600.000	Fund receives Fixed 2,81%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Goldman Sachs	15/8/2032	(48.733)	(48.733)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IRS	EUR 6.240.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 3,0782%	Goldman Sachs	15/7/2033	(11.309)	(11.309)
IRS	EUR 28.625.000	Fund receives Fixed 2,78%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Goldman Sachs	1/8/2033	(25.114)	(12.972)
IRS	EUR 8.870.000	Fund receives Fixed 3%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Goldman Sachs	17/8/2033	78.918	73.418
IRS	EUR 4.349.600	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,72691%	Goldman Sachs	4/11/2042	150.262	163.040
IRS	EUR 11.085.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,8133%	Goldman Sachs	15/8/2048	52.205	52.205
IRS	EUR 8.600.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,193%	Goldman Sachs	4/10/2052	915.429	915.429
IRS	KRW 16.702.858.200	Fund receives Fixed 1,6425%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	HSBC Bank	21/9/2023	(13.992)	(13.992)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 374.872.308)					596.599	230.117

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Euro Corporate Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Irlande							
383.038	iShares GBP Corp Bond 0-5yr UCITS ETF ⁻	43.675.585	1,56				
Total des Compartiments		43.675.585	1,56				
OBLIGATIONS							
Australie							
EUR 6.000.000	APA Infrastructure 2% 15/7/2030	5.137.470	0,18				
EUR 7.000.000	Toyota Finance Australia 2,28% 21/10/2027	6.637.878	0,24				
		11.775.348	0,42				
Autriche							
EUR 12.400.000	BAWAG 2,375% 26/3/2029*	11.637.400	0,41				
EUR 2.800.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 2% 25/8/2032	2.490.740	0,09				
EUR 6.500.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 4,125% 18/1/2027	6.415.370	0,23				
EUR 2.600.000	Kommunalkredit Austria 0,25% 14/5/2024	2.504.138	0,09				
EUR 6.600.000	Raiffeisen Bank International 4,75% 26/1/2027	6.505.587	0,23				
		29.553.235	1,05				
Belgique							
EUR 4.430.000	Anheuser-Busch InBev 1,65% 28/3/2031	3.852.037	0,14				
EUR 17.000.000	Argenta Spaarbank 1,375% 8/2/2029	14.492.500	0,52				
EUR 3.200.000	Argenta Spaarbank 5,375% 29/11/2027	3.240.800	0,11				
EUR 7.300.000	Belfius Bank 1,25% 6/4/2034	5.856.425	0,21				
EUR 4.694.000	Euroclear Bank 0,125% 7/7/2025	4.394.757	0,16				
EUR 4.800.000	FLUVIUS System Operator CVBA 0,25% 2/12/2030*	3.774.160	0,13				
EUR 9.300.000	Fluxys Belgium 1,75% 5/10/2027	8.422.731	0,30				
EUR 16.100.000	KBC 0,125% 10/9/2026	14.837.205	0,53				
EUR 200.000	KBC 4,25% 24/10/2025	175.800	0,01				
EUR 7.100.000	KBC 4,375% 6/12/2031	7.083.989	0,25				
		66.130.404	2,36				
Canada							
EUR 200.000	Royal Bank of Canada 0,125% 23/7/2024	193.203	0,01				
EUR 9.100.000	Toronto-Dominion Bank/The 3,631% 13/12/2029	8.793.124	0,31				
EUR 10.200.000	TotalEnergies Capital Canada 2,125% 18/9/2029	9.351.829	0,33				
		18.338.156	0,65				
Îles Caïmans							
USD 965.000	CK Hutchison International 23 4,75% 21/4/2028	867.058	0,03				
USD 965.000	CK Hutchison International 23 4,875% 21/4/2033	857.515	0,03				
USD 1.000.000	Meituan 3,05% 28/10/2030	728.599	0,03				
		2.453.172	0,09				
				Danemark			
EUR 13.317.000	Danske Bank 1% 15/5/2031	11.925.374	0,42				
EUR 500.000	Danske Bank 4% 12/1/2027	497.006	0,02				
EUR 4.600.000	Danske Bank 4,75% 21/6/2030	4.641.400	0,17				
EUR 4.075.000	Orsted 3,25% 13/9/2031	3.875.131	0,14				
EUR 2.700.000	Orsted 5,25% 8/12/3022	2.648.957	0,09				
		23.587.868	0,84				
				Finlande			
EUR 4.700.000	Nordea Bank 4,125% 5/5/2028	4.702.826	0,17				
EUR 12.764.000	OP Corporate Bank 1,625% 9/6/2030	11.921.576	0,42				
EUR 200.000	OP Corporate Bank 4% 13/6/2028	200.869	0,01				
		16.825.271	0,60				
				France			
EUR 7.900.000	AXA 3,25% 28/5/2049	7.178.493	0,26				
EUR 100.000	AXA 4,25% 10/3/2043	92.305	0,00				
EUR 12.555.000	AXA 5,5% 11/7/2043	12.578.415	0,45				
EUR 17.200.000	Banque Federative du Credit Mutuel 3,875% 14/2/2028*	17.091.210	0,61				
EUR 10.400.000	Banque Federative du Credit Mutuel 4,125% 13/3/2029	10.451.650	0,37				
EUR 26.600.000	Banque Federative du Credit Mutuel 5,125% 13/1/2033	26.135.113	0,93				
EUR 11.700.000	BNP Paribas 0,5% 15/7/2025	11.330.748	0,41				
EUR 18.700.000	BNP Paribas 0,875% 11/7/2030	15.233.488	0,54				
EUR 400.000	BNP Paribas 1,125% 17/4/2029	344.468	0,01				
EUR 17.100.000	BNP Paribas 2,1% 7/4/2032*	14.293.622	0,51				
EUR 26.700.000	BNP Paribas 2,5% 31/3/2032	24.051.894	0,86				
EUR 1.200.000	BNP Paribas 4,125% 24/5/2033	1.203.677	0,04				
EUR 9.600.000	Bouygues 4,625% 7/6/2032	10.017.679	0,36				
EUR 3.100.000	Bouygues 5,375% 30/6/2042	3.362.477	0,12				
EUR 5.600.000	BPCE 0,25% 14/1/2031	4.273.093	0,15				
EUR 2.600.000	BPCE 0,5% 15/9/2027	2.311.712	0,08				
EUR 3.400.000	BPCE 0,5% 14/1/2028*	7.359.494	0,26				
EUR 3.600.000	BPCE 1,75% 2/2/2034	2.975.805	0,11				
EUR 8.400.000	BPCE 2,125% 13/10/2046	6.237.000	0,22				
EUR 13.000.000	BPCE 4% 29/11/2032*	12.806.170	0,46				
EUR 1.900.000	BPCE 4,75% 14/6/2034	1.904.228	0,07				
EUR 8.600.000	BPCE SFH 3% 17/10/2029	8.435.095	0,30				
EUR 5.400.000	BPCE SFH 3,125% 20/1/2033	5.285.034	0,19				
EUR 10.700.000	Cie de Saint-Gobain 1,625% 10/8/2025	10.274.354	0,36				
EUR 1.300.000	Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes 1% 19/5/2031	1.075.059	0,04				
EUR 8.200.000	Coentreprise de Transport d'Electricite 0,875% 29/9/2024	7.913.701	0,28				
EUR 4.000.000	Coentreprise de Transport d'Electricite 2,125% 29/7/2032	3.456.696	0,12				
EUR 10.700.000	Credit Agricole 1,625% 5/6/2030	10.055.553	0,36				
EUR 8.700.000	Credit Agricole 4% 12/10/2026	8.686.385	0,31				
EUR 2.900.000	Credit Agricole 4% 18/1/2033	2.887.113	0,10				
EUR 4.800.000	Credit Agricole 4,125% 7/3/2030	4.843.143	0,17				
EUR 2.800.000	Credit Agricole Assurances 1,5% 6/10/2031	2.124.734	0,08				
EUR 13.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 3,125% 22/6/2027*	12.873.770	0,46				
EUR 3.000.000	Electricite de France 2% 9/12/2049	1.768.192	0,06				
EUR 400.000	Electricite de France 3,375% 15/6/2030	311.600	0,01				
EUR 11.400.000	Electricite de France 4,625% 25/1/2043	10.960.017	0,39				

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
GBP 7.500.000	Electricite de France 5,875% 22/1/2029	7.387.209	0,27	EUR 7.000.000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	6.283.900	0,22
EUR 12.000.000	Engie 4% 11/1/2035	11.852.520	0,42	EUR 19.300.000	Deutsche Bank 5% 5/9/2030	18.775.040	0,67
EUR 3.000.000	Engie 4,25% 11/1/2043	2.938.875	0,11	EUR 6.700.000	Deutsche Bank 5,625% 19/5/2031	6.506.705	0,23
EUR 4.815.000	Firmenich Productions Participations 1,75% 30/4/2030	4.248.692	0,15	EUR 10.000.000	Deutsche Pfandbriefbank 0,1% 2/2/2026	8.878.600	0,32
EUR 5.000.000	Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR 1,85% 21/4/2042	3.723.716	0,13	EUR 4.500.000	Eurogrid 1,875% 10/6/2025	4.345.740	0,15
EUR 29.300.000	La Banque Postale 4,375% 17/1/2030	28.933.164	1,03	EUR 8.000.000	Eurogrid 3,722% 27/4/2030	7.923.700	0,28
EUR 6.800.000	La Poste 1,375% 21/4/2032	5.634.469	0,20	EUR 9.100.000	Evonik Industries 0,625% 18/9/2025	8.506.498	0,30
EUR 5.200.000	Orange 2,375% 15/1/2025	4.969.380	0,18	EUR 11.700.000	Evonik Industries 1,375% 2/9/2081*	9.759.496	0,35
EUR 2.800.000	Orange 3,625% 16/11/2031	2.804.051	0,10	EUR 1.564.000	Fraport Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875% 31/3/2028*	1.414.349	0,05
EUR 2.900.000	Orange 5,375% 18/1/2030	2.889.760	0,10	EUR 4.000.000	Fraport Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125% 9/7/2027*	3.719.340	0,13
EUR 21.400.000	Societe Generale 2,625% 30/5/2029	19.925.964	0,71	EUR 5.000.000	Hamburg Commercial Bank 0,5% 22/9/2026	4.479.000	0,16
EUR 8.700.000	Societe Generale 4,122% 13/1/2025	8.708.091	0,31	EUR 6.023.000	Heidelberg Materials 2,25% 3/6/2024	5.939.371	0,21
EUR 4.000.000	Societe Generale 4,125% 2/6/2027	4.001.013	0,14	EUR 8.615.000	Heidelberg Materials 3,75% 31/5/2032	8.152.418	0,29
EUR 5.900.000	Societe Generale 4,25% 6/12/2030	5.727.425	0,21	EUR 2.300.000	Merck Financial Services 0,5% 16/7/2028	2.002.684	0,07
EUR 4.400.000	Societe Generale 5,625% 2/6/2033	4.361.206	0,16	EUR 800.000	Merck Financial Services 2,375% 15/6/2030	748.932	0,03
EUR 10.800.000	Teleperformance 3,75% 24/6/2029*	10.115.906	0,36	EUR 7.500.000	Porsche Automobil 4,25% 27/9/2030	7.403.363	0,26
EUR 11.088.000	TotalEnergies 1,625% 25/10/2027	9.305.604	0,33	EUR 3.000.000	Robert Bosch 4% 2/6/2035	2.992.725	0,11
EUR 7.000.000	TotalEnergies 3,369% 6/10/2026	6.565.592	0,24	EUR 14.100.000	Robert Bosch 4,375% 2/6/2043	14.096.052	0,50
EUR 5.400.000	Veolia Environnement 1,625% 21/9/2032	4.542.185	0,16	EUR 16.565.000	RWE 2,75% 24/5/2030	15.339.025	0,55
EUR 17.800.000	Veolia Environnement 2,25% 20/1/2026*	16.206.900	0,58	EUR 5.700.000	Volkswagen Bank 1,25% 10/6/2024	5.574.315	0,20
EUR 8.800.000	Veolia Environnement 2,5% 20/1/2029	7.330.400	0,26	EUR 6.910.000	Volkswagen Financial Services 1,5% 1/10/2024	6.728.958	0,24
EUR 2.100.000	Vinci 1,75% 26/9/2030	1.875.165	0,07	EUR 3.361.000	Volkswagen Leasing 1,375% 20/1/2025	3.245.494	0,12
EUR 7.400.000	WPP Finance 4,125% 30/5/2028	7.405.402	0,27	EUR 10.900.000	Vonovia 1% 16/6/2033	7.425.393	0,26
		463.635.876	16,54	EUR 3.400.000	Vonovia 5% 23/11/2030*	3.334.720	0,12
						287.432.673	10,25
	Allemagne				Hong Kong		
EUR 8.600.000	Allianz 2,121% 8/7/2050	7.137.230	0,25	USD 1.000.000	AIA 4,95% 4/4/2033	904.023	0,03
EUR 3.000.000	Allianz 2,6% 30/10/2031	2.020.050	0,07		Hongrie		
EUR 5.300.000	Allianz 4,252% 5/7/2052	4.930.855	0,18	EUR 11.600.000	Erste Bank Hungary Zrt 1,25% 4/2/2026	10.664.576	0,38
EUR 8.600.000	Allianz 4,597% 7/9/2038	8.422.840	0,30		Inde		
EUR 8.700.000	Allianz 5,824% 25/7/2053	8.997.279	0,32	USD 1.000.000	Export-Import Bank of India 3,875% 12/3/2024	912.461	0,03
EUR 7.200.000	BASF 4,25% 8/3/2032	7.352.784	0,26	USD 500.000	REC 5,625% 11/4/2028	455.292	0,02
EUR 18.000.000	Bayer 2,375% 12/11/2079	16.806.204	0,60			1.367.753	0,05
EUR 23.440.000	Bayer 4,625% 26/5/2033	23.756.446	0,85		Indonésie		
EUR 300.000	Bayerische Landesbank 1% 23/9/2031	251.820	0,01	USD 380.000	Bank Mandiri Persero 5,5% 4/4/2026	349.614	0,01
EUR 8.600.000	Bayerische Landesbank 1,375% 22/11/2032	6.881.423	0,25	USD 1.280.000	Pertamina Geothermal Energy 5,15% 27/4/2028*	1.166.511	0,04
EUR 8.900.000	Bertelsmann 3,5% 29/5/2029	8.713.011	0,31			1.516.125	0,05
EUR 300.000	Commerzbank 1,25% 23/10/2023	298.825	0,01		Irlande		
EUR 1.100.000	Commerzbank 1,375% 29/12/2031*	920.975	0,03	EUR 16.103.000	Bank of Ireland 0,375% 10/5/2027	14.464.264	0,52
EUR 16.800.000	Commerzbank 5,125% 18/1/2030	16.679.796	0,60	EUR 10.045.000	Bank of Ireland 1,875% 5/6/2026	9.601.001	0,34
EUR 2.600.000	Deutsche Bahn Finance 0,95% 22/1/2025	2.399.949	0,09	EUR 504.000	Eaton Capital 0,128% 8/3/2026	461.772	0,02
EUR 10.856.000	Deutsche Bahn Finance 1,125% 29/5/2051	6.185.060	0,22				
EUR 2.300.000	Deutsche Bahn Finance 1,875% 24/5/2030	2.102.308	0,08				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 12.413.000	GAS Networks Ireland 0,125% 4/12/2024	11.841.506	0,42	EUR 630.000	Medtronic Global 1,125% 7/3/2027	578.195	0,02
EUR 2.933.000	GAS Networks Ireland 1,375% 5/12/2026	2.725.138	0,10	EUR 4.226.000	Medtronic Global 1,625% 7/3/2031	3.672.498	0,13
EUR 8.600.000	Linde 3,375% 12/6/2029	8.557.774	0,30	EUR 4.111.000	Medtronic Global 2,625% 15/10/2025	4.011.041	0,14
GBP 6.911.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity 5,125% 23/11/2052	7.157.352	0,25	EUR 4.021.000	Segro Capital 1,875% 23/3/2030	3.465.999	0,12
		54.808.807	1,95	EUR 4.600.000	SELP Finance 0,875% 27/5/2029	3.676.818	0,13
	Italie			EUR 11.880.000	SELP Finance 1,5% 20/11/2025	11.074.851	0,40
EUR 5.625.000	A2A 4,375% 3/2/2034*	5.555.334	0,20	EUR 5.175.000	SELP Finance 3,75% 10/8/2027	4.896.507	0,17
EUR 5.325.000	ASTM 2,375% 25/11/2033	4.156.056	0,15	EUR 15.471.000	SES 2,875% 27/5/2026	13.493.033	0,48
EUR 4.766.000	CA Auto Bank 0% 16/4/2024*	4.647.760	0,16	EUR 9.800.000	Traton Finance Luxembourg 4,125% 22/11/2025	9.738.652	0,35
EUR 9.000.000	CA Auto Bank 4,25% 24/3/2024	8.999.730	0,32			99.604.715	3,55
EUR 834.000	Enel 2,25% 10/12/2026	735.300	0,03		Malaisie		
EUR 6.175.000	Enel 6,625% 16/4/2031*	6.312.394	0,22	USD 1.415.000	Khazanah Capital 4,876% 1/6/2033	1.272.012	0,04
EUR 7.455.000	Eni 2% 11/2/2027	6.381.480	0,23	USD 1.430.000	Khazanah Global Sukuk 4,687% 1/6/2028	1.298.196	0,05
EUR 3.588.000	Eni 2,625% 13/10/2025	3.335.073	0,12			2.570.208	0,09
EUR 7.005.000	Eni 4,25% 19/5/2033	6.969.862	0,25		Pays-Bas		
EUR 19.790.000	Hera 0,25% 3/12/2030*	15.123.615	0,54	EUR 33.200.000	ABN AMRO Bank 4,375% 20/10/2028*	33.185.226	1,18
EUR 22.200.000	Intesa Sanpaolo 4,875% 19/5/2030	22.377.739	0,80	EUR 3.600.000	Achmea Bank 3% 31/1/2030	3.529.980	0,13
EUR 8.775.000	Intesa Sanpaolo 5,125% 29/8/2031	8.904.914	0,32	EUR 5.745.000	BP Capital Markets 4,323% 12/5/2035	5.696.282	0,20
EUR 10.100.000	Intesa Sanpaolo 5,25% 13/1/2030	10.405.775	0,37	EUR 2.550.000	Coca-Cola HBC Finance 2,75% 23/9/2025	2.498.936	0,09
EUR 3.440.000	Italgas 0,5% 16/2/2033	2.471.556	0,09	EUR 10.500.000	Cooperatieve Rabobank 4% 10/1/2030	10.377.727	0,37
EUR 2.569.000	Snam 0,75% 17/6/2030	2.080.181	0,07	EUR 6.000.000	de Volksbank 0,01% 16/9/2024	5.756.865	0,20
EUR 4.475.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0,375% 25/9/2030*	3.538.827	0,13	EUR 3.000.000	de Volksbank 1,75% 22/10/2030	2.760.768	0,10
EUR 3.212.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0,75% 24/7/2032	2.488.500	0,09	EUR 3.500.000	de Volksbank 2,375% 4/5/2027	3.296.584	0,12
EUR 11.394.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 3,875% 24/7/2033	11.289.574	0,40	EUR 4.800.000	de Volksbank 4,875% 7/3/2030	4.853.208	0,17
		125.773.670	4,49	EUR 500.000	Digital Dutch Finco 0,625% 15/7/2025	461.808	0,02
	Japon			EUR 4.900.000	Digital Intrepid 0,625% 15/7/2031	3.545.787	0,13
EUR 18.758.000	Nissan Motor 3,201% 17/9/2028	17.133.839	0,61	EUR 100.000	EDP Finance 1,625% 26/1/2026	95.168	0,00
EUR 13.700.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank 0,01% 15/10/2027	11.771.157	0,42	EUR 8.270.000	ELM for Firmenich International 3,75% 3/9/2025*	7.976.001	0,28
EUR 11.300.000	Takeda Pharmaceutical 2,25% 21/11/2026	10.763.727	0,39	EUR 6.550.000	EnBW International Finance 4% 24/1/2035	6.390.442	0,23
		39.668.723	1,42	EUR 3.100.000	EnBW International Finance 4,049% 22/11/2029	3.134.937	0,11
	Jersey			EUR 5.000.000	Enel Finance International 0% 17/6/2024	4.846.125	0,17
EUR 259.000	Aptiv 1,5% 10/3/2025	249.038	0,01	EUR 8.375.000	Enel Finance International 0% 28/5/2026	7.553.664	0,27
EUR 5.400.000	Glencore Finance Europe 1,875% 13/9/2023	5.396.436	0,19	EUR 3.710.000	Enel Finance International 0,375% 28/5/2029	3.061.479	0,11
		5.645.474	0,20	EUR 3.530.000	Enexis 0,625% 17/6/2032	2.785.693	0,10
	Luxembourg			EUR 6.495.000	Enexis 0,75% 2/7/2031*	5.317.310	0,19
EUR 5.457.000	Becton Dickinson Euro Finance 0,334% 13/8/2028	4.624.371	0,17	EUR 7.100.000	Enexis 3,625% 12/6/2034	7.091.516	0,25
EUR 2.731.000	Becton Dickinson Euro Finance 1,213% 12/2/2036	1.953.493	0,07	EUR 7.000.000	Iberdrola International 1,874% 28/1/2026	6.354.250	0,23
EUR 4.000.000	Becton Dickinson Euro Finance 1,336% 13/8/2041	2.500.220	0,09	EUR 7.900.000	Iberdrola International 2,625% 26/12/2023	7.805.200	0,28
EUR 7.071.000	GELF Bond Issuer I 1,125% 18/7/2029	5.765.481	0,21	EUR 2.400.000	Iberdrola International 3,25% 12/11/2024	2.343.600	0,08
EUR 7.143.000	GELF Bond Issuer I 1,625% 20/10/2026*	6.464.344	0,23	EUR 20.700.000	ING Groep 0,25% 18/2/2029	17.163.177	0,61
EUR 6.250.000	Holcim Finance Luxembourg 0,5% 23/4/2031	4.750.448	0,17	EUR 1.400.000	ING Groep 0,375% 29/9/2028	1.189.675	0,04
EUR 8.599.000	Holcim Finance Luxembourg 0,625% 19/1/2033	6.210.146	0,22				
EUR 13.249.000	Holcim Finance Luxembourg 1,5% 6/4/2025	12.728.618	0,45				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 12.800.000	ING Groep 4,75% 23/5/2034	12.784.000	0,46		Portugal		
EUR 1.200.000	ING Groep 5% 20/2/2035	1.170.805	0,04	EUR 6.400.000	EDP - Energias de Portugal 3,875% 26/6/2028	6.420.448	0,23
EUR 5.457.000	Koninklijke Ahold Delhaize 1,125% 19/3/2026	5.130.071	0,18	EUR 962.895	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos 0,7% 12/2/2024	953.016	0,03
EUR 5.300.000	Mercedes-Benz International Finance 3,7% 30/5/2031	5.312.415	0,19			7.373.464	0,26
EUR 1.400.000	Naturgy Finance 2,374% 23/11/2026	1.243.900	0,05		Qatar		
EUR 6.626.000	Nederlandse Gasunie 1% 11/5/2026*	6.182.663	0,22	USD 1.000.000	Qatar Government International Bond 4% 14/3/2029	891.349	0,03
EUR 4.000.000	Redexis Gas Finance 1,875% 28/5/2025	3.839.980	0,14		Singapour		
EUR 5.650.000	RELX Finance 3,75% 12/6/2031	5.632.259	0,20	USD 10.630.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	9.818.040	0,35
EUR 4.505.000	Repsol International Finance 4,247% 11/9/2028*	4.100.676	0,14		Corée du Sud		
EUR 5.000.000	Shell International Finance 0,5% 8/11/2031	3.911.782	0,14	USD 2.815.000	GS Caltex 5,375% 7/8/2028	2.576.101	0,09
EUR 17.953.000	Shell International Finance 1,875% 7/4/2032	15.626.743	0,56	USD 214.000	Shinhan Finacial 2,875% 12/5/2026	174.147	0,01
EUR 4.000.000	Siemens Financieringsmaatschappij 3,375% 24/8/2031	3.958.274	0,14	USD 570.000	SK Broadband 4,875% 28/6/2028	518.222	0,02
EUR 2.500.000	Telefonica Europe 3% 2/10/2023	2.493.250	0,09	USD 860.000	SK On 5,375% 11/5/2026	789.651	0,03
EUR 3.433.000	TenneT 0,5% 9/6/2031	2.851.673	0,10			4.058.121	0,15
EUR 765.000	TenneT 0,875% 16/6/2035	584.617	0,02		Espagne		
EUR 10.000.000	TenneT 4,5% 28/10/2034	10.578.250	0,38	EUR 6.400.000	Banco de Sabadell 3,5% 28/8/2026*	6.373.976	0,23
EUR 6.275.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4,375% 9/5/2030	5.439.076	0,20	EUR 6.100.000	Banco Santander 0,125% 4/6/2030*	4.877.900	0,17
EUR 21.700.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,875% 15/9/2031*	22.764.494	0,81	EUR 7.200.000	Banco Santander 3,25% 14/2/2028*	7.122.875	0,25
EUR 4.770.000	Thermo Fisher Scientific Finance I 1,625% 18/10/2041	3.248.277	0,12	EUR 800.000	Banco Santander 3,375% 11/1/2026	794.303	0,03
EUR 13.581.000	Toyota Motor Finance Netherlands 3,625% 24/4/2025*	13.499.310	0,48	EUR 4.500.000	Banco Santander 3,375% 11/1/2030*	4.459.257	0,16
EUR 845.000	Universal Music 3,75% 30/6/2032	824.014	0,03	EUR 4.400.000	Banco Santander 3,625% 21/3/2029	2.872.320	0,10
EUR 7.600.000	Universal Music 4% 13/6/2031	7.561.810	0,27	EUR 12.400.000	Banco Santander 4,25% 12/6/2030	12.458.280	0,45
EUR 5.800.000	Volkswagen International Finance 3,5% 17/6/2025	5.478.390	0,20	EUR 800.000	CaixaBank 0,375% 18/11/2026	729.937	0,03
EUR 2.000.000	Volkswagen International Finance 3,5% 20/3/2030*	1.616.702	0,06	EUR 9.000.000	CaixaBank 4,25% 6/9/2030	9.031.212	0,32
EUR 5.000.000	Volkswagen International Finance 3,748% 28/12/2027	4.344.250	0,15	EUR 4.900.000	CaixaBank 5,375% 14/11/2030	5.049.229	0,18
EUR 13.800.000	Volkswagen International Finance 4,625% 27/6/2028*	12.400.312	0,44	EUR 13.000.000	CaixaBank 6,125% 30/5/2034	12.994.020	0,46
EUR 8.855.000	Wolters Kluwer 3% 23/9/2026	8.705.616	0,31	EUR 6.600.000	Iberdrola Finanzas 4,875% 25/4/2028	6.408.824	0,23
EUR 6.525.000	Wolters Kluwer 3,75% 3/4/2031	6.518.119	0,23	EUR 2.034.000	NorteGas Energia Distribucion 2,065% 28/9/2027*	1.863.622	0,06
		336.873.136	12,01	EUR 200.000	Santander Consumer Finance 0,375% 27/6/2024	194.024	0,01
	Nouvelle-Zélande					75.229.779	2,68
EUR 11.353.000	Chorus 0,875% 5/12/2026*	10.200.614	0,37		Suède		
EUR 21.738.000	Chorus 1,125% 18/10/2023	21.655.830	0,77	EUR 321.000	Lansforsakringar Bank 0,125% 19/2/2025	302.353	0,01
EUR 6.010.000	Chorus 3,625% 7/9/2029	5.863.717	0,21	EUR 4.016.000	Skandinaviska Enskilda Banken 1,375% 31/10/2028	3.999.936	0,14
		37.720.161	1,35	EUR 9.014.000	Swedbank 0,25% 2/11/2026	8.012.951	0,29
	Norvège			EUR 11.013.000	Swedbank 1,5% 18/9/2028	11.024.013	0,39
EUR 7.047.000	DNB Bank 3,125% 21/9/2027	6.881.395	0,25	EUR 4.040.000	Telia 0,125% 27/11/2030*	3.136.744	0,11
EUR 20.800.000	DNB Bank 4,5% 19/7/2028	21.000.304	0,75	EUR 800.000	Telia 3,625% 22/2/2032	789.596	0,03
		27.881.699	1,00	EUR 12.275.000	Volvo Treasury 2,125% 1/9/2024	12.036.006	0,43
						39.301.599	1,40
					Suisse		
				EUR 4.856.000	Credit Suisse 0,25% 1/9/2028	4.009.891	0,14
				EUR 10.000.000	Credit Suisse 5,5% 20/8/2026	10.334.640	0,37

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 4.700.000	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft 4,84% 3/11/2028	4.745.070	0,17				
EUR 21.908.000	UBS 0,65% 14/1/2028	19.389.456	0,69				
EUR 3.425.000	UBS 0,65% 10/9/2029	2.759.034	0,10				
EUR 26.685.000	UBS 2,875% 2/4/2032	23.933.243	0,86				
EUR 30.567.000	UBS 7,75% 1/3/2029	34.562.718	1,23				
		99.734.052	3,56				
	Thaïlande						
USD 1.000.000	Minor International 2,7% 19/4/2026	841.471	0,03				
	Royaume-Uni						
EUR 9.481.000	Anglo American Capital 4,75% 21/9/2032*	9.369.788	0,34				
EUR 2.190.000	AstraZeneca 3,75% 3/3/2032	2.216.500	0,08				
EUR 18.900.000	Barclays 5,262% 29/1/2034	18.895.936	0,67				
EUR 15.173.000	BAT International Finance 0,875% 13/10/2023	15.117.922	0,54				
EUR 17.006.000	BP Capital Markets 3,625% 22/3/2029	14.990.775	0,54				
EUR 1.691.000	British Telecommunications 1% 23/6/2024	1.650.357	0,06				
EUR 14.536.000	Cadent Finance 0,625% 19/3/2030	11.633.960	0,42				
EUR 17.275.000	Chanel Ceres 1% 31/7/2031	13.774.566	0,49				
EUR 4.898.000	Channel Link Enterprises Finance 2,706% 30/6/2050	4.477.531	0,16				
EUR 11.225.000	DS Smith 4,375% 27/7/2027	11.247.338	0,40				
EUR 13.625.000	DS Smith 4,5% 27/7/2030	13.541.342	0,48				
EUR 200.000	GlaxoSmithKline Capital 1,375% 12/9/2029	177.647	0,01				
EUR 29.442.000	HSBC 4,787% 10/3/2032	29.584.965	1,06				
EUR 7.893.000	HSBC 6,364% 16/11/2032	8.088.786	0,29				
GBP 6.356.000	Marks & Spencer 4,5% 10/7/2027	6.771.792	0,24				
EUR 6.431.000	National Grid 0,163% 20/1/2028	5.465.660	0,19				
EUR 3.500.000	National Grid 0,75% 1/9/2033	2.495.566	0,09				
EUR 2.533.000	National Grid 2,949% 30/3/2030	2.353.638	0,08				
EUR 5.100.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands 3,53% 20/9/2028	4.991.796	0,18				
EUR 8.128.000	National Grid Electricity Transmission 0,823% 7/7/2032	6.238.403	0,22				
EUR 722.000	Nationwide Building Society 2% 25/7/2029	702.091	0,02				
EUR 221.396	Paragon Mortgages No 12 4,261% 15/11/2038	207.747	0,01				
EUR 17.175.000	Santander UK 0,603% 13/9/2029	13.947.045	0,50				
EUR 3.801.000	Santander UK 3,53% 25/8/2028	3.636.692	0,13				
EUR 1.309.000	Sky 2,5% 15/9/2026	1.258.947	0,04				
EUR 4.386.000	SSE 1,75% 16/4/2030	3.839.085	0,14				
EUR 8.055.000	SSE 4% 21/1/2028	7.451.366	0,27				
USD 315.000	Standard Chartered 1,214% 23/3/2025	281.586	0,01				
EUR 2.160.000	Tesco Corporate Treasury Services 4,25% 27/2/2031	2.134.506	0,07				
GBP 226.413	Tesco Property Finance 3 5,744% 13/4/2040	246.169	0,01				
EUR 3.405.000	Thames Water Utilities Finance 4% 18/4/2027	3.260.288	0,12				
EUR 20.435.000	Thames Water Utilities Finance 4,375% 18/1/2031	19.257.470	0,68				
		239.307.260	8,54				
					États-Unis		
EUR 1.400.000	AbbVie 1,25% 18/11/2031	1.174.554	0,04				
EUR 1.674.000	Air Products and Chemicals 0,8% 5/5/2032	1.316.476	0,05				
EUR 7.200.000	Air Products and Chemicals 4% 3/3/2035	7.240.428	0,26				
EUR 13.065.000	Altria 3,125% 15/6/2031	11.267.536	0,40				
EUR 3.084.000	American Tower 0,875% 21/5/2029	2.532.720	0,09				
EUR 11.941.000	American Tower 0,95% 5/10/2030	9.452.316	0,34				
EUR 1.191.000	American Tower 1% 15/1/2032	903.447	0,03				
EUR 7.650.000	American Tower 4,625% 16/5/2031	7.645.181	0,27				
EUR 15.845.000	AT&T 4,3% 18/11/2034	15.546.333	0,56				
EUR 38.127.000	Bank of America 2,824% 27/4/2033	34.095.741	1,22				
EUR 10.125.000	Bank of America 4,134% 12/6/2028	10.115.381	0,36				
EUR 205.000	BAT Capital 1,125% 16/11/2023	203.683	0,01				
EUR 3.519.000	Becton Dickinson 0,034% 13/8/2025	3.266.617	0,12				
EUR 7.691.000	Booking 0,1% 8/3/2025	7.265.688	0,26				
EUR 4.700.000	Booking 4,25% 15/5/2029	4.780.465	0,17				
EUR 21.800.000	Citigroup 1,25% 6/7/2026	20.677.204	0,74				
EUR 6.500.000	Citigroup 1,5% 24/7/2026	6.183.671	0,22				
EUR 1.450.000	Coca-Cola 0,125% 9/3/2029	1.207.727	0,04				
EUR 3.000.000	Coca-Cola 0,4% 6/5/2030	2.457.704	0,09				
EUR 2.268.000	Comcast 0% 14/9/2026	2.030.858	0,07				
EUR 1.950.000	Comcast 0,25% 20/5/2027	1.721.813	0,06				
EUR 3.423.000	Eli Lilly 1,375% 14/9/2061	1.737.532	0,06				
EUR 200.000	Fidelity National Information Services 0,625% 3/12/2025	186.130	0,01				
EUR 5.932.000	Fidelity National Information Services 1,1% 15/7/2024	5.781.683	0,21				
EUR 2.300.000	Fidelity National Information Services 1,5% 21/5/2027	2.111.320	0,07				
EUR 5.700.000	Fiserv 4,5% 24/5/2031	5.748.763	0,20				
EUR 12.305.000	General Motors Financial 0,65% 7/9/2028*	10.197.389	0,36				
EUR 1.898.000	General Motors Financial 1,694% 26/3/2025	1.829.906	0,06				
EUR 1.400.000	General Motors Financial 4,3% 15/2/2029	1.371.307	0,05				
EUR 15.015.000	Global Payments 4,875% 17/3/2031*	15.004.397	0,53				
EUR 28.040.000	Goldman Sachs 0,875% 9/5/2029	23.125.569	0,82				
EUR 500.000	Goldman Sachs 4,214% 30/4/2024	500.275	0,02				
EUR 3.475.000	Honeywell International 3,75% 17/5/2032	3.397.247	0,12				
EUR 2.500.000	International Business Machines 1,25% 29/1/2027	2.307.071	0,08				
EUR 5.300.000	International Business Machines 3,625% 6/2/2031	5.243.654	0,19				
EUR 10.632.000	International Business Machines 3,75% 6/2/2035	10.376.938	0,37				
EUR 23.259.000	JPMorgan Chase 1,963% 23/3/2030	20.723.303	0,74				
EUR 15.850.000	Kraft Heinz Foods 4,254% 9/5/2025*	15.888.119	0,57				
EUR 2.100.000	Linde 1,625% 1/12/2025	2.006.478	0,07				
EUR 7.575.000	McDonald's 3% 31/5/2034	6.928.627	0,25				
EUR 3.335.000	McDonald's 4,25% 7/3/2035*	3.386.771	0,12				
EUR 17.100.000	Morgan Stanley 0,497% 7/2/2031*	13.427.762	0,48				
EUR 11.600.000	Morgan Stanley 4,656% 2/3/2029	11.727.136	0,42				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Euro Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	
EUR 11.600.000	Morgan Stanley 5,148% 25/1/2034	12.194.616	0,44	EUR 11.069.000	Verizon Communications 1,125% 19/9/2035	7.784.292	0,28	
EUR 4.900.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 0,993% 15/10/2026	3.566.833	0,13	GBP 5.415.000	Verizon Communications 1,875% 19/9/2030	4.906.346	0,18	
EUR 6.545.000	Nasdaq 4,5% 15/2/2032	6.659.407	0,24	EUR 14.650.000	Verizon Communications 4,75% 31/10/2034	15.244.790	0,54	
EUR 5.843.000	Prologis Euro Finance 0,5% 16/2/2032	4.266.077	0,15	EUR 5.000.000	Wells Fargo 0,625% 14/8/2030	3.930.554	0,14	
EUR 10.450.000	Realty Income 5,125% 6/7/2034	10.479.939	0,37			401.409.006	14,33	
EUR 14.793.000	RELX Capital 1,3% 12/5/2025	14.150.281	0,51	Total des obligations			2.542.695.214	90,70
EUR 64.277	SLM Student Loan Trust 2003-7 4,076% 15/12/2033	60.282	0,00	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			2.586.370.799	92,26
EUR 3.000.000	Toyota Motor Credit 4,05% 13/9/2029	3.038.268	0,11	Total du portefeuille			2.586.370.799	92,26
USD 1.215.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	1.034.401	0,04	Autres éléments de l'actif net			217.076.885	7,74
				Total de l'actif net (EUR)			2.803.447.684	100,00

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
CAD	9.400.000	USD	7.146.278	Bank of America	20/9/2023	(180.801)
EUR	81.945.531	CHF	79.813.800	Goldman Sachs	20/9/2023	(1.427.387)
EUR	2.241.050	NOK	25.900.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(104)
EUR	87.206.695	GBP	74.870.000	JP Morgan	17/10/2023	(99.425)
EUR	25.377.041	USD	28.520.000	Standard Chartered Bank	17/10/2023	(854.500)
EUR	283.585	USD	320.000	Nomura	17/10/2023	(10.738)
EUR	6.064.267	GBP	5.260.000	State Street	17/10/2023	(69.433)
EUR	2.228.447	NOK	24.900.000	Deutsche Bank	20/9/2023	73.823
EUR	2.884.695	GBP	2.480.000	Société Générale	17/10/2023	(7.240)
EUR	2.036.500	HUF	803.000.000	Société Générale	20/9/2023	(66.395)
EUR	2.357.736	HUF	914.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(35.846)
EUR	315.507	GBP	270.000	Standard Chartered Bank	17/10/2023	660
GBP	1.750.000	USD	2.264.033	Barclays	20/9/2023	(41.889)
GBP	3.640.000	USD	4.669.952	Morgan Stanley	20/9/2023	(50.993)
GBP	22.600.000	EUR	26.187.665	BNY Mellon	17/10/2023	166.259
HUF	2.491.000.000	EUR	6.400.662	Deutsche Bank	20/9/2023	122.766
HUF	836.000.000	EUR	2.142.788	JP Morgan	20/9/2023	46.528
HUF	872.000.000	EUR	2.192.387	BNP Paribas	20/9/2023	91.205
JPY	3.626.000.000	USD	25.321.730	Bank of America	20/9/2023	(413.357)
JPY	1.344.000.000	USD	9.658.853	BNP Paribas	20/9/2023	(404.820)
JPY	331.000.000	USD	2.287.114	Morgan Stanley	20/9/2023	(15.276)
NOK	25.500.000	USD	2.375.642	Deutsche Bank	20/9/2023	18.595
NOK	50.800.000	EUR	4.320.986	Goldman Sachs	20/9/2023	74.792
NOK	25.100.000	USD	2.335.633	Goldman Sachs	20/9/2023	20.830
NZD	11.360.000	USD	7.083.301	Morgan Stanley	20/9/2023	(300.880)
NZD	11.630.000	USD	7.229.196	Toronto-Dominion	20/9/2023	(287.348)
NZD	3.450.000	USD	2.118.248	HSBC Bank	20/9/2023	(61.048)
USD	4.705.788	GBP	3.740.000	JP Morgan	20/9/2023	(32.760)
USD	2.299.568	GBP	1.800.000	Morgan Stanley	20/9/2023	16.238
USD	2.466.380	GBP	1.930.000	Bank of America	20/9/2023	18.085
USD	2.198.844	GBP	1.730.000	Barclays	20/9/2023	5.203
USD	4.914.014	NOK	50.600.000	Deutsche Bank	20/9/2023	147.296
USD	2.569.057	JPY	355.000.000	Barclays	20/9/2023	123.319

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Corporate Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
USD	2.379.733	JPY	326.000.000	BNP Paribas	20/9/2023	132.165
USD	7.235.457	NZD	11.360.000	Morgan Stanley	20/9/2023	441.014
USD	7.132.024	CAD	9.400.000	Morgan Stanley	20/9/2023	167.673
USD	4.531.800	GBP	3.490.000	HSBC Bank	20/9/2023	98.894
USD	2.268.688	NZD	3.660.000	HSBC Bank	20/9/2023	84.567
USD	7.015.125	JPY	1.000.500.000	Bank of America	20/9/2023	140.078
USD	2.333.085	JPY	333.500.000	UBS	20/9/2023	41.820
USD	1.979.591	GBP	1.560.000	BNP Paribas	20/9/2023	1.761
USD	6.867.853	EUR	6.280.000	Barclays	20/9/2023	45.236
Moins-value nette non réalisée						(2.281.433)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	3.096.249	EUR	3.231.739	BNY Mellon	15/9/2023	1.607
EUR	40.637	CHF	38.871	BNY Mellon	15/9/2023	45
Plus-value nette non réalisée						1.652
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	2.410	GBP	2.064	BNY Mellon	15/9/2023	-
GBP	321.944	EUR	373.337	BNY Mellon	15/9/2023	2.641
Plus-value nette non réalisée						2.641
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
EUR	405.618	JPY	64.197.776	BNY Mellon	15/9/2023	266
JPY	4.707.150.666	EUR	30.121.438	BNY Mellon	15/9/2023	(399.461)
Moins-value nette non réalisée						(399.195)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
EUR	33.156	SEK	394.152	BNY Mellon	15/9/2023	(145)
SEK	11.806.649	EUR	1.007.111	BNY Mellon	15/9/2023	(9.575)
Moins-value nette non réalisée						(9.720)
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	68.463	USD	74.726	BNY Mellon	15/9/2023	(376)
USD	9.874.618	EUR	9.000.758	BNY Mellon	15/9/2023	95.936
Plus-value nette non réalisée						95.560
Total des moins-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 537.737.313)						(2.590.495)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
647	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	75.071.410	458.392
(1.509)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	200.697.000	(560.870)
335	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	44.709.100	(630.060)
6.714	EUR	Euro Schatz	Septembre 2023	705.607.830	(201.823)
(138)	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	15.995.580	75.620
(198)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	20.237.283	(185.120)
171	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	18.280.488	206.293
(47)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	5.608.607	(82.435)
(76)	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	8.465.151	(73.679)
(38)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	3.740.814	(23.906)
Total				1.098.413.263	(1.017.588)

Euro Corporate Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 5.600.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2023	(62.967)	(11.401)
CDS	EUR 5.277.000	Fund receives default protection on Heidelbergcement; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	(50.447)	(857.290)
CDS	EUR 8.832.000	Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(23.427)	145.744
CDS	EUR 16.025.577	Fund receives default protection on ITRAXX.EUR.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(98.937)	(210.228)
CDS	EUR 3.518.000	Fund receives default protection on Holcim; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(35.214)	627
CDS	EUR 6.772.286	Fund receives default protection on Holcim; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(63.519)	1.207
CDS	EUR 5.013.286	Fund receives default protection on Heidelbergcement; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	(39.649)	(814.448)
CDS	EUR 10.290.286	Fund receives default protection on Next; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(203.694)	7.067
CDS	EUR 137.191.500	Fund receives default protection on ITRAXX.FINSR.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(2.121.889)	(1.193.525)
CDS	EUR 272.920.000	Fund receives default protection on ITRAXX.FINSUB.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(10.719.958)	5.479.479
IFS	EUR 15.375.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,56%	Goldman Sachs	15/6/2028	13.050	13.050
IFS	EUR 15.250.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,46%	Goldman Sachs	15/7/2028	60.102	60.102
IFS	EUR 7.380.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,435%	Goldman Sachs	15/5/2033	72.108	74.428
IFS	EUR 15.365.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,555%	Goldman Sachs	15/6/2033	(11.592)	(11.592)
IFS	EUR 15.350.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,505%	Goldman Sachs	15/7/2033	(59.937)	(59.937)
IFS	EUR 8.870.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,755%	Goldman Sachs	15/6/2053	58.670	58.670
IFS	EUR 4.032.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,5737%	Goldman Sachs	15/5/2038	(18.195)	(18.195)
IFS	EUR 7.455.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,60125%	Goldman Sachs	15/5/2043	(78.833)	(73.798)
IRS	EUR 27.864.000	Fund receives Fixed 0,7996%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Goldman Sachs	23/2/2032	(4.651.399)	(4.646.672)
IRS	EUR 56.000.000	Fund receives Fixed 2,4985%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Goldman Sachs	6/9/2032	(2.428.865)	(2.428.865)
IRS	USD 2.500.000	Fund receives Fixed 0,9775%; and pays Floating USD-Federal Funds-H.15-OIS-COMPOUND 1 Day	Goldman Sachs	20/10/2050	(1.008.553)	(1.008.553)
IRS	USD 2.500.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 0,903825%	Goldman Sachs	20/10/2050	1.053.110	1.053.110
IRS	EUR 9.940.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 0,79722%	Goldman Sachs	23/2/2052	3.760.912	3.744.101
IRS	EUR 22.000.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,19%	Goldman Sachs	6/9/2052	2.369.332	2.369.332
IRS	EUR 2.025.814	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,607%	Goldman Sachs	27/2/2053	49.986	49.986
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 650.052.179)					(14.239.805)	1.722.399

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Euro Reserve Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
Canada				Royaume-Uni			
EUR 2.000.000	Bank of Nova Scotia/The 3,776% 14/6/2024	2.001.640	1,47	EUR 1.000.000	Barclays Bank 0% 6/11/2023	1.000.387	0,73
EUR 1.000.000	Bank of Nova Scotia/The 3,943% 12/7/2024	1.000.835	0,73	EUR 2.000.000	Barclays Bank 0% 10/11/2023	1.984.982	1,46
EUR 2.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 4% 14/6/2024	1.998.770	1,47	EUR 3.000.000	NTT Finance 0% 22/9/2023	2.992.830	2,20
				EUR 2.000.000	NTT Finance 0% 22/9/2023	1.995.220	1,46
				EUR 500.000	Standard Chartered Bank 0% 3/4/2024	488.138	0,36
				EUR 500.000	UBS (London Branch) 0% 20/10/2023	497.371	0,36
		5.001.245	3,67			8.958.928	6,57
Total des obligations		5.001.245	3,67	États-Unis			
				EUR 3.000.000	Colgate-Palmolive 0% 14/9/2023	2.995.365	2,20
				Total des billets de trésorerie			
						63.379.675	46,50
BILLET DE TRÉSORERIE				CERTIFICATS DE DÉPÔT			
Autriche				Canada			
EUR 3.500.000	Oesterreichische Kontrollbank 0% 12/9/2023	3.497.200	2,57	EUR 1.500.000	Toronto Dominion Bank 0% 19/8/2024	1.500.000	1,10
				EUR 2.500.000	Toronto Dominion Bank 36% 18/7/2024	2.500.000	1,84
						4.000.000	2,94
				Finlande			
				EUR 1.000.000	Nordea Bank 0% 1/9/2023	999.798	0,73
				EUR 1.000.000	Nordea Bank 0% 20/9/2023	1.000.020	0,73
				EUR 500.000	OP Corporate Bank 0% 17/6/2024	484.162	0,36
						2.483.980	1,82
				France			
				EUR 1.000.000	Credit Agricole (London Branch) 0% 8/4/2024	975.861	0,72
				Japon			
				EUR 500.000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking 0% 1/9/2023	499.898	0,37
				EUR 500.000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking 0% 10/11/2023	496.245	0,37
				EUR 500.000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking 0% 13/11/2023	496.083	0,36
				EUR 1.000.000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking 0% 1/12/2023	990.204	0,73
				EUR 500.000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking 0% 10/1/2024	492.887	0,36
				EUR 500.000	Mizuho Bank 0% 8/9/2023	499.542	0,37
				EUR 1.000.000	Mizuho Bank 0% 19/9/2023	997.968	0,73
				EUR 1.000.000	Mizuho Bank 0% 2/1/2024	986.754	0,72
				EUR 1.000.000	Mizuho International 0% 20/11/2023	991.445	0,73
				EUR 1.000.000	Mizuho International 0% 8/2/2024	982.656	0,72
				EUR 1.000.000	MUFG Bank 0% 8/9/2023	999.075	0,73
				EUR 1.000.000	MUFG Bank 0% 17/10/2023	995.017	0,73
				EUR 1.500.000	Sumitomo Mitsui Banking 0% 4/9/2023	1.499.227	1,10
				EUR 1.500.000	Sumitomo Mitsui Banking 0% 8/9/2023	1.498.609	1,10
				EUR 1.000.000	Sumitomo Mitsui Banking 0% 14/9/2023	998.455	0,73
				EUR 1.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank 0% 8/9/2023	999.072	0,73
						14.423.137	10,58
				Pays-Bas			
				EUR 4.000.000	ABN AMRO Bank 0% 1/9/2023	3.999.230	2,93
				EUR 500.000	ABN AMRO Bank 0% 2/1/2024	493.541	0,36
						4.492.771	3,29
				Suède			
EUR 500.000	Skandinaviska Enskilda Banken 0% 17/6/2024	484.308	0,35				

Euro Reserve Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Royaume-Uni			
EUR 500.000	KEB Hana Bank (London Branch) 0% 1/12/2023	494.989	0,36
EUR 500.000	National Westminster Bank 0% 2/11/2023	496.676	0,37
EUR 600.000	National Westminster Bank 0% 5/1/2024	591.801	0,44
EUR 500.000	UBS (London Branch) 0% 3/1/2024	493.279	0,36
		2.076.745	1,53
États-Unis			
EUR 500.000	Citibank 0% 2/1/2024	493.335	0,36
	Total des certificats de dépôt	28.945.829	21,24
	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	97.326.749	71,41
	Total du portefeuille	97.326.749	71,40
	Autres éléments de l'actif net	38.976.933	28,60
	Total de l'actif net (EUR)	136.303.682	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Short Duration Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				EUR 26.600.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 0,375% 10/3/2026	24.468.010	0,52
OBLIGATIONS				EUR 9.300.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 0,25% 8/2/2027*	8.297.134	0,18
Australie				EUR 10.600.000	National Bank of Canada 3,5% 25/4/2028*	10.579.118	0,22
EUR 18.200.000	Australia & New Zealand Banking 3,437% 4/4/2025	18.092.347	0,38	EUR 20.000.000	Royal Bank of Canada 0,125% 26/4/2027	17.688.224	0,37
EUR 24.400.000	Commonwealth Bank of Australia 0,75% 28/2/2028	21.584.362	0,46	EUR 25.300.000	Toronto-Dominion Bank/The 0,864% 24/3/2027*	23.000.483	0,49
EUR 18.250.000	Commonwealth Bank of Australia 3,768% 31/8/2027	18.356.215	0,39	EUR 10.000.000	Toronto-Dominion Bank/The 1,707% 28/7/2025	9.628.218	0,20
EUR 43.416.000	National Australia Bank 0,625% 16/3/2027	39.091.549	0,82	EUR 6.600.000	Toronto-Dominion Bank/The 3,666% 8/9/2031	6.633.330	0,14
		97.124.473	2,05	EUR 3.000.000	TotalEnergies Capital Canada 2,125% 18/9/2029	2.750.538	0,06
Autriche						141.519.256	2,99
EUR 16.100.000	BAWAG 2,375% 26/3/2029*	15.109.850	0,32	Îles Caïmans			
EUR 5.400.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 4,125% 18/1/2027	5.329.692	0,11	GBP 900.000	Trafford Centre Finance 6,128% 28/7/2035	751.865	0,02
EUR 3.200.000	Kommunalkredit Austria 0,25% 14/5/2024	3.082.016	0,07	Chine			
EUR 7.400.000	Raiffeisen Bank International 1,5% 24/5/2027	6.849.588	0,14	EUR 20.725.000	China Development Bank 0% 27/10/2023	20.603.137	0,43
EUR 18.500.000	Raiffeisen-Landesbank Steiermark 3,75% 26/6/2026	18.511.470	0,39	Chypre			
EUR 29.000.000	Republic of Austria Government Bond 0% 15/7/2024	28.111.440	0,59	EUR 9.425.000	Cyprus Government International Bond 0% 9/2/2026*	8.639.002	0,18
EUR 10.000.000	Republic of Austria Government Bond 0% 20/4/2025	9.491.500	0,20	EUR 49.000.000	Cyprus Government International Bond 0,625% 3/12/2024	47.312.195	1,00
EUR 15.000.000	Republic of Austria Government Bond 2% 15/7/2026	14.603.250	0,31			55.951.197	1,18
		101.088.806	2,13	République tchèque			
Belgique				EUR 8.600.000	UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia 3,75% 20/6/2028*	8.543.928	0,18
EUR 19.100.000	Argenta Spaarbank 1% 6/2/2024	18.847.116	0,40	Danemark			
EUR 7.100.000	Argenta Spaarbank 5,375% 29/11/2027*	7.190.525	0,15	EUR 19.500.000	Danske Bank 1% 15/5/2031	17.462.250	0,37
EUR 6.600.000	Belfius Bank 3,875% 12/6/2028	6.589.440	0,14	EUR 16.600.000	Danske Bank 4% 12/1/2027	16.500.613	0,35
EUR 6.250.000	Euroclear Bank 0,125% 7/7/2025	5.851.562	0,12			33.962.863	0,72
EUR 5.600.000	KBC 0,125% 10/9/2026	5.160.767	0,11	Finlande			
EUR 4.700.000	KBC 0,75% 24/1/2030	3.832.671	0,08	EUR 12.400.000	Aktia Bank 3,375% 31/5/2027	12.367.450	0,26
EUR 5.100.000	KBC 4,375% 6/12/2031	5.088.500	0,11	EUR 11.075.000	CRH Finland Services 0,875% 5/11/2023	11.012.925	0,23
EUR 800.000	KBC Bank 0% 3/12/2025*	738.936	0,01	EUR 20.000.000	Finland Government Bond 0% 15/9/2024*	19.319.050	0,41
EUR 33.000.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,8% 22/6/2025	31.677.360	0,67	EUR 16.000.000	Finland Government Bond 0,875% 15/9/2025	15.316.980	0,32
EUR 13.650.000	Kingdom of Belgium Government Bond 4,5% 28/3/2026	14.140.888	0,30	EUR 9.100.000	Nordea Bank 4,375% 6/9/2026	9.129.575	0,19
		99.117.765	2,09	EUR 4.100.000	Oma Saastopankki 0,01% 25/11/2027	3.536.250	0,08
Canada				EUR 8.800.000	OP Corporate Bank 1,625% 9/6/2030	8.219.200	0,18
EUR 11.877.000	Bank of Montreal 1% 5/4/2026	11.084.032	0,23	EUR 17.320.000	OP Mortgage Bank 3,125% 20/10/2028	17.145.934	0,36
EUR 24.200.000	Bank of Nova Scotia/The 0,01% 15/12/2027	20.850.962	0,44			96.047.364	2,03
EUR 7.100.000	Bank of Nova Scotia/The 0,45% 16/3/2026	6.539.207	0,14	France			
				EUR 36.300.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 3,375% 25/5/2033	36.210.339	0,76
				EUR 19.500.000	Arkea Home Loans SFH 3% 30/3/2027	19.197.165	0,40
				EUR 8.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel 2,625% 6/11/2029	7.238.524	0,15

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 8.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel 3,875% 14/2/2028	7.949.400	0,17	EUR 2.343.844	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 4,484% 27/8/2061	2.354.105	0,05
EUR 1.300.000	Banque Federative du Credit Mutuel 3,875% 16/6/2032	1.227.736	0,03	EUR 2.100.000	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 5,134% 27/8/2061	2.094.222	0,05
EUR 9.400.000	BNP Paribas 0,5% 4/6/2026	8.834.778	0,19	EUR 5.620.162	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 4,484% 27/5/2061	5.647.932	0,12
EUR 7.200.000	BNP Paribas 1,125% 17/4/2029	6.200.423	0,13	EUR 600.000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 4,734% 27/5/2061	590.137	0,01
EUR 13.400.000	BNP Paribas 2,5% 31/3/2032	12.070.988	0,25	EUR 25.400.000	La Banque Postale 1% 9/2/2028	22.551.430	0,48
EUR 2.000.000	BPCE 1,625% 2/3/2029	1.768.767	0,04	EUR 11.500.000	La Banque Postale Home Loan SFH 3,125% 19/2/2029	11.357.285	0,24
EUR 7.700.000	BPCE 4,125% 10/7/2028	7.734.073	0,16	EUR 3.200.000	Orange 3,625% 16/11/2031	3.204.630	0,07
EUR 3.900.000	BPCE 5,75% 1/6/2033	3.947.892	0,08	EUR 5.500.000	Societe Generale 4,25% 6/12/2030	5.339.125	0,11
EUR 8.500.000	BPCE SFH 3,25% 12/4/2028*	8.438.502	0,18	EUR 34.700.000	Societe Generale SFH 3,625% 31/7/2026	34.813.642	0,73
EUR 36.900.000	Bpifrance 0,125% 25/11/2023	36.576.572	0,77	EUR 3.072.000	TotalEnergies 1,625% 25/10/2027	2.578.176	0,05
EUR 49.600.000	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France 0% 17/1/2024	48.907.336	1,03	EUR 15.661.000	TotalEnergies 1,75% 4/4/2024	15.261.644	0,32
EUR 31.600.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat 3,375% 28/6/2032	31.581.514	0,67	EUR 9.884.000	TotalEnergies 2,625% 26/2/2025	9.424.518	0,20
EUR 9.000.000	Caisse Francaise de Financement Local 3,125% 16/11/2027*	8.918.757	0,19	EUR 11.000.000	Veolia Environnement 1,625% 1/6/2026	9.696.500	0,21
EUR 16.400.000	Cie de Financement Foncier 0,05% 16/4/2024*	16.029.114	0,34	EUR 16.300.000	Veolia Environnement 2,25% 20/1/2026	14.841.150	0,31
EUR 10.400.000	Cie de Saint-Gobain 0,625% 15/3/2024	10.218.520	0,22			979.213.714	20,66
EUR 3.000.000	Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes 1% 19/5/2031	2.480.904	0,05		Allemagne		
EUR 2.100.000	Coentreprise de Transport d'Electricite 1,5% 29/7/2028	1.886.204	0,04	EUR 29.400.000	Bayer 2,375% 12/11/2079	27.450.133	0,58
EUR 10.500.000	Credit Agricole 0,625% 12/1/2028*	9.283.729	0,20	EUR 28.175.000	Bayer 4,25% 26/8/2029	28.421.813	0,60
EUR 14.400.000	Credit Agricole 1,625% 5/6/2030	13.532.707	0,29	EUR 7.100.000	Bertelsmann 3,5% 29/5/2029	6.950.829	0,15
EUR 5.000.000	Credit Agricole Home Loan SFH 3,25% 28/9/2026*	4.974.923	0,10	EUR 153.566.000	Bundesobligation 0% 18/10/2024*	148.045.207	3,12
EUR 5.700.000	Credit Agricole Public Sector SCF 3,75% 13/7/2026	5.733.003	0,12	EUR 24.640.000	Bundesobligation 0% 11/4/2025*	23.471.771	0,50
EUR 25.400.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 0,25% 30/4/2024*	24.805.132	0,52	EUR 19.810.810	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,5% 15/2/2025*	19.082.499	0,40
EUR 372.873	FCT Autonomia 2019 4,492% 25/9/2035	372.769	0,01	EUR 46.435.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,5% 15/2/2026*	43.910.677	0,93
EUR 46.609	FCT Autonomia 2019 4,842% 25/9/2035	46.452	0,00	EUR 80.000.000	Bundesschatzanweisungen 0,4% 13/9/2024*	77.661.000	1,64
EUR 31.120	FCT Autonomia 2019 5,242% 25/9/2035	30.996	0,00	EUR 187.000.000	Bundesschatzanweisungen 2,2% 12/12/2024*	184.576.948	3,89
EUR 46.539	FCT Autonomia 2019 6,342% 25/9/2035	46.289	0,00	EUR 1.900.000	Commerzbank 1,375% 29/12/2031*	1.590.775	0,03
EUR 46.609	FCT Autonomia 2019 7,342% 25/9/2035	46.259	0,00	EUR 7.400.000	Commerzbank 5,125% 18/1/2030	7.347.053	0,16
EUR 1.247.644	FCT Noria 2021 4,742% 25/10/2049	1.227.212	0,03	EUR 4.500.000	Deutsche Bahn Finance 0,95% 22/1/2025	4.153.759	0,09
EUR 534.705	FCT Noria 2021 5,142% 25/10/2049	521.316	0,01	EUR 14.600.000	Deutsche Bank 5% 5/9/2030	14.202.880	0,30
EUR 196.538	FCT Pixel 2021 5,576% 25/2/2038	193.481	0,00	EUR 37.775.000	Fraport Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625% 9/7/2024	36.978.325	0,78
EUR 171.750.000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/2/2025*	163.789.388	3,46	EUR 2.500.000	Heidelberg Materials 3,75% 31/5/2032	2.365.763	0,05
EUR 40.000.000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/3/2025*	38.075.333	0,80	EUR 46.531.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,125% 10/10/2028	46.752.022	0,99
EUR 158.415.000	French Republic Government Bond OAT 1% 25/11/2025*	151.576.769	3,20	EUR 37.231	Red & Black Auto Germany 6 UG 5,038% 15/10/2028	37.174	0,00
EUR 37.570.000	French Republic Government Bond OAT 1,75% 25/11/2024*	36.857.438	0,78	EUR 37.231	Red & Black Auto Germany 6 UG 5,888% 15/10/2028	37.133	0,00
EUR 30.000.000	French Republic Government Bond OAT 2,25% 25/5/2024*	29.704.500	0,63	EUR 311.630	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,388% 15/9/2030	310.204	0,01
EUR 82.400.000	French Republic Government Bond OAT 2,5% 24/9/2026	81.224.014	1,71	EUR 311.631	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,588% 15/9/2030	306.696	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 77.908	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,988% 15/9/2030	76.065	0,00	EUR 641.327	SCF Rahoituspalvelut IX 4,622% 25/10/2030	637.904	0,02
EUR 7.300.000	Robert Bosch 4,375% 2/6/2043	7.297.956	0,15	GBP 8.102.725	Taurus 2019-2 UK 6,538% 17/11/2029	9.314.657	0,20
EUR 2.000.000	RWE 0,5% 26/11/2028*	1.713.078	0,03	GBP 2.564.454	Taurus 2019-2 UK 7,138% 17/11/2029	2.909.773	0,06
EUR 18.700.000	Vonovia 0,375% 16/6/2027	15.734.241	0,33	GBP 2.075.308	Taurus 2019-2 UK 7,438% 17/11/2029	2.321.161	0,05
		698.474.001	14,74	GBP 855.715	Taurus 2021-1 UK 6,519% 17/5/2031	944.475	0,02
	Grèce			GBP 536.063	Taurus 2021-1 UK 6,869% 17/5/2031	579.982	0,01
EUR 2.500.000	Hellenic Republic Government Bond 4,375% 18/7/2038	2.590.587	0,05	GBP 483.449	Taurus 2021-1 UK 7,819% 17/5/2031	541.916	0,01
	International			GBP 3.320.965	Taurus 2021-4 UK 6,169% 17/8/2031	3.757.111	0,08
EUR 21.700.000	European Union 0,8% 4/7/2025	20.737.822	0,43	GBP 409.273	Taurus 2021-4 UK 7,319% 17/8/2031	439.411	0,01
	Irlande					133.462.614	2,81
GBP 5.738.856	Agora UK 2021 6,37% 22/7/2031	6.453.831	0,14		Italie		
GBP 1.142.299	Atom Mortgage 7,07% 22/7/2031	1.123.063	0,02	EUR 156.665	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen 4,888% 15/4/2032	156.449	0,00
EUR 150.000	Avoca CLO XIV 8,361% 12/1/2031	142.772	0,00	EUR 60.256	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen 5,438% 15/4/2032	60.193	0,00
EUR 150.000	Avoca CLO XIV 10,011% 12/1/2031	132.126	0,00	EUR 57.845	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen 6,488% 15/4/2032	58.071	0,00
EUR 7.803.000	Bank of Ireland 0,375% 10/5/2027	7.008.921	0,15	EUR 24.102	Asset-Backed European Securitisation Transaction Seventeen 7,488% 15/4/2032	24.252	0,00
EUR 4.767.000	Bank of Ireland 1,875% 5/6/2026	4.555.941	0,09	EUR 223.015	AutoFlorence 1 5,042% 25/12/2042	222.826	0,01
EUR 8.023.681	Haus European Loan Conduit No 39 4,364% 28/7/2051	7.560.747	0,16	EUR 621.038	AutoFlorence 2 4,387% 24/12/2044	610.833	0,01
EUR 1.038.700	Haus European Loan Conduit No 39 4,814% 28/7/2051	929.736	0,02	EUR 286.314	AutoFlorence 2 4,787% 24/12/2044	278.378	0,01
EUR 840.757	Haus European Loan Conduit No 39 5,114% 28/7/2051	693.368	0,01	EUR 153.531	AutoFlorence 2 5,987% 24/12/2044	150.498	0,00
EUR 31.000.000	Ireland Government Bond 3,4% 18/3/2024	30.970.550	0,65	EUR 6.426.000	AutoFlorence 3 4,592% 25/12/2046	6.448.969	0,14
EUR 15.000.000	Ireland Government Bond 5,4% 13/3/2025	15.495.575	0,33	EUR 689.000	AutoFlorence 3 5,992% 25/12/2046	690.541	0,02
GBP 1.051.000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 8,636% 17/8/2033	1.228.295	0,03	EUR 185.000	AutoFlorence 3 6,992% 25/12/2046	185.596	0,00
GBP 908.000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 9,636% 17/8/2033	1.061.305	0,02	EUR 190.000	AutoFlorence 3 8,992% 25/12/2046	190.990	0,01
EUR 1.331.397	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,187% 17/8/2033	1.246.321	0,03	EUR 23.600.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 0,875% 8/10/2026	21.323.662	0,45
EUR 795.303	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,687% 17/8/2033	720.910	0,01	EUR 14.200.000	Banco BPM 3,75% 27/6/2028	14.206.390	0,30
EUR 6.169.730	Last Mile PE 2021 4,687% 17/8/2031	5.957.707	0,13	EUR 143.000	Brignole 2021 4,437% 24/7/2036	142.070	0,00
EUR 1.987.582	Last Mile PE 2021 4,837% 17/8/2031	1.887.580	0,04	EUR 100.000	Brignole 2021 5,237% 24/7/2036	98.285	0,00
EUR 938.803	Last Mile PE 2021 4,987% 17/8/2031	882.242	0,02	EUR 814.966	Cassia 2022-1 6,883% 22/5/2034	753.095	0,02
EUR 1.060.777	Last Mile PE 2021 5,387% 17/8/2031	977.568	0,02	EUR 6.875.000	Enel 6,375% 16/4/2028	7.027.969	0,15
EUR 7.200.000	Linde 3,375% 12/6/2029	7.164.648	0,15	EUR 2.000.000	Eni 2% 18/5/2031*	1.743.262	0,04
EUR 4.210.272	Lt Autorahoitus IV 4,313% 18/7/2033	4.217.969	0,09	EUR 8.730.000	Eni 2,625% 13/10/2025	8.114.600	0,17
EUR 600.000	Lt Autorahoitus IV 5,673% 18/7/2033	601.902	0,01	EUR 3.000.000	Eni 3,625% 19/5/2027	2.974.950	0,06
EUR 7.892.288	Pearl Finance 2020 5,187% 17/11/2032	7.764.828	0,16	EUR 17.600.000	Intesa Sanpaolo 0,5% 5/3/2024	17.296.048	0,36
EUR 1.128.144	Pearl Finance 2020 5,687% 17/11/2032	1.104.986	0,02	EUR 16.900.000	Intesa Sanpaolo 3,625% 30/6/2028	16.875.580	0,36
EUR 1.354.717	Pearl Finance 2020 6,287% 17/11/2032	1.319.156	0,03				
EUR 535.575	River Green Finance 2020 4,748% 22/1/2032	507.961	0,01				
EUR 323.275	River Green Finance 2020 5,098% 22/1/2032	306.216	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 47.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0% 29/11/2023*	46.608.850	0,98				
EUR 26.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0% 15/8/2024*	25.123.516	0,53	EUR 26.900.000	Pays-Bas ABN AMRO Bank 3,875% 21/12/2026	26.913.719	0,57
EUR 37.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0% 15/12/2024*	35.344.042	0,75	EUR 10.900.000	ABN AMRO Bank 5,125% 22/2/2033*	10.720.150	0,23
EUR 29.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,2% 15/8/2025	27.717.789	0,58	EUR 4.580.828	Asset-Backed European Securitisations Transaction Twenty-One 4,332% 21/9/2031	4.601.510	0,10
EUR 14.500.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,85% 1/7/2025	14.065.043	0,30	EUR 5.350.000	Coca-Cola HBC Finance 2,75% 23/9/2025	5.242.866	0,11
EUR 76.212.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,8% 15/4/2026	76.704.252	1,62	EUR 10.800.000	de Volksbank 0,01% 16/9/2024	10.362.357	0,22
EUR 3.336.461	Koromo Italy 4,432% 26/2/2035	3.342.878	0,07	EUR 14.700.000	de Volksbank 1,75% 22/10/2030	13.527.764	0,29
EUR 518.310	Red & Black Auto Italy 6,482% 28/12/2031	505.902	0,01	EUR 6.700.000	de Volksbank 2,375% 4/5/2027	6.310.604	0,13
EUR 4.375.000	Snam 0% 15/8/2025	4.055.100	0,09	EUR 4.340.430	Domi 2021-1 4,156% 15/6/2053	4.317.292	0,09
EUR 6.476.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 3,625% 21/4/2029	6.393.028	0,13	EUR 1.251.448	Dutch Property Finance 2020-2 4,504% 28/1/2058	1.251.329	0,03
EUR 34.950.000	UniCredit 3,375% 31/1/2027	34.689.797	0,73	EUR 290.000	Dutch Property Finance 2020-2 5,064% 28/1/2058	289.190	0,00
		374.183.704	7,90	EUR 8.858.625	Dutch Property Finance 2021-1 4,364% 28/7/2058	8.856.614	0,19
	Japon			EUR 739.000	Dutch Property Finance 2021-1 4,814% 28/7/2058	733.770	0,01
EUR 15.450.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank 3,629% 6/4/2026	15.341.263	0,32	EUR 820.000	Dutch Property Finance 2021-2 4,514% 28/4/2059	801.528	0,02
	Lettonie			EUR 504.000	Dutch Property Finance 2021-2 4,764% 28/4/2059	486.548	0,01
EUR 775.000	Latvia Government International Bond 3,5% 17/1/2028	768.091	0,02	EUR 3.224.026	Dutch Property Finance 2023-1 4,614% 28/4/2064	3.231.761	0,07
	Luxembourg			EUR 9.650.000	EnBW International Finance 3,5% 24/7/2028*	9.564.935	0,20
EUR 2.000.000	Becton Dickinson Euro Finance 3,553% 13/9/2029	1.970.953	0,04	EUR 21.700.000	Enel Finance International 0% 28/5/2026	19.571.881	0,41
EUR 528.000	BL Consumer Credit 2021 4,742% 25/9/2038	524.768	0,01	EUR 8.533.000	Enel Finance International 0,375% 28/5/2029	7.041.401	0,15
EUR 681.000	BL Consumer Credit 2021 5,292% 25/9/2038	674.329	0,01	EUR 22.100.000	Iberdrola International 1,874% 28/1/2026	20.061.275	0,42
EUR 355.000	BL Consumer Credit 2021 6,492% 25/9/2038	349.364	0,01	EUR 4.900.000	Iberdrola International 2,625% 26/12/2023	4.841.200	0,10
EUR 4.900.000	Bumper De 4,192% 23/8/2032	4.908.338	0,10	EUR 8.100.000	Iberdrola International 3,25% 12/11/2024	7.909.650	0,17
EUR 42.170.000	European Financial Stability Facility 3% 15/12/2028	41.993.940	0,89	EUR 6.000.000	ING Groep 0,25% 18/2/2029	4.974.834	0,10
EUR 38.440.000	European Financial Stability Facility 3,375% 30/8/2038	38.498.621	0,81	EUR 6.800.000	ING Groep 0,375% 29/9/2028	5.778.420	0,12
EUR 900.000	FACT Master 4,582% 20/7/2028	892.655	0,02	EUR 15.500.000	ING Groep 1,25% 16/2/2027	14.376.250	0,30
EUR 2.199.853	Germany Compartment Consumer 2020-1 4,771% 14/11/2034	2.198.862	0,05	EUR 21.200.000	ING Groep 2,5% 15/2/2029	20.897.900	0,44
EUR 799.947	Germany Compartment Consumer 2020-1 5,371% 14/11/2034	799.452	0,02	EUR 10.200.000	ING Groep 4,5% 23/5/2029	10.189.800	0,22
EUR 439.971	Germany Compartment Consumer 2020-1 6,121% 14/11/2034	437.881	0,01	EUR 201.000	Jubilee Place 5,263% 17/1/2059	193.231	0,00
EUR 20.000.000	Holcim Finance Luxembourg 1,5% 6/4/2025	19.214.459	0,40	EUR 151.710	Magoi 2019 4,532% 27/7/2039	150.681	0,00
EUR 8.661.000	Medtronic Global 1,125% 7/3/2027	7.948.806	0,17	EUR 50.540	Magoi 2019 4,932% 27/7/2039	49.855	0,00
EUR 4.313.000	Medtronic Global 2,625% 15/10/2025	4.208.130	0,09	EUR 25.332	Magoi 2019 5,332% 27/7/2039	24.826	0,00
EUR 8.750.000	Segro Capital 1,25% 23/3/2026*	8.107.750	0,17	EUR 25.331	Magoi 2019 6,132% 27/7/2039	25.126	0,00
EUR 6.300.000	Traton Finance Luxembourg 4,125% 22/11/2025	6.260.562	0,13	EUR 6.000.000	Netherlands Government Bond 0% 15/1/2024*	5.924.400	0,13
		138.988.870	2,93	EUR 25.000.000	Netherlands Government Bond 0,25% 15/7/2025*	23.748.792	0,50
	Monténégro			EUR 9.625.000	RELX Finance 0% 18/3/2024	9.411.710	0,20
EUR 8.036.000	Montenegro Government International Bond 2,875% 16/12/2027	6.932.376	0,15	EUR 4.725.000	RELX Finance 3,75% 12/6/2031	4.710.164	0,10
				EUR 3.000.000	Shell International Finance 0,5% 8/11/2031	2.347.069	0,05
				EUR 1.100.000	Telefonica Europe 3% 2/10/2023	1.097.030	0,02
				EUR 11.029.000	Toyota Motor Finance Netherlands 3,625% 24/4/2025	10.962.661	0,23

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 6.275.000	Universal Music 4% 13/6/2031	6.243.468	0,13	EUR 51.734	Autonomia Spain 2019 5,492% 27/12/2035	51.239	0,00
EUR 5.200.000	Van Lanschot Kempen 3,5% 31/5/2026*	5.178.784	0,11	EUR 51.734	Autonomia Spain 2019 6,492% 27/12/2035	50.846	0,00
EUR 7.232.000	Volkswagen International Finance 5,125% 4/9/2023	7.258.758	0,16	EUR 51.734	Autonomia Spain 2019 7,642% 27/12/2035	50.555	0,00
EUR 2.000.000	Wolters Kluwer 1,5% 22/3/2027	1.863.288	0,04	EUR 1.465.292	Autonomia Spain 2021 FT 4,442% 31/1/2039	1.447.400	0,03
EUR 2.000.000	Wolters Kluwer 3% 23/9/2026	1.966.260	0,04	EUR 1.282.130	Autonomia Spain 2021 FT 4,692% 31/1/2039	1.255.179	0,03
EUR 4.525.000	Wolters Kluwer 3,75% 3/4/2031	4.520.792	0,10	EUR 488.430	Autonomia Spain 2021 FT 5,192% 31/1/2039	476.424	0,01
		308.531.443	6,51	EUR 305.269	Autonomia Spain 2021 FT 6,292% 31/1/2039	294.882	0,01
	Nouvelle-Zélande			EUR 122.108	Autonomia Spain 2021 FT 7,542% 31/1/2039	117.031	0,00
EUR 15.075.000	ANZ New Zealand Int'l 0,5% 17/1/2024	14.889.879	0,31	EUR 58.200.000	Banco Santander 0,01% 27/2/2025	55.003.656	1,16
EUR 6.750.000	ANZ New Zealand Int'l 3,951% 17/7/2026*	6.796.440	0,14	EUR 2.600.000	Banco Santander 3,375% 11/1/2026	2.581.484	0,06
EUR 19.400.000	Bank of New Zealand 3,708% 20/12/2028	19.430.264	0,41	EUR 2.216.075	BBVA Consumer Auto 2020-1 FTA 4,455% 20/1/2036	2.219.510	0,05
EUR 5.550.000	Chorus 1,125% 18/10/2023	5.529.021	0,12	EUR 233.185	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3,5% 21/3/2033	220.145	0,00
NZD 2.149.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2% 20/9/2025	1.498.630	0,03	EUR 349.778	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 4,522% 21/3/2033	346.032	0,01
NZD 8.991.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,5% 20/9/2040	5.807.267	0,12	EUR 116.593	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5,522% 21/3/2033	114.789	0,00
		53.951.501	1,13	EUR 16.800.000	Santander Consumer Finance 0,375% 27/6/2024	16.298.016	0,34
	Norvège			EUR 180.975.000	Spain Government Bond 0% 31/5/2025	170.768.915	3,60
EUR 14.825.000	DNB Bank 0,05% 14/11/2023	14.715.814	0,31	EUR 77.000.000	Spain Government Bond 0% 31/1/2026	71.282.248	1,50
EUR 3.875.000	SpareBank 1 Boligkredditt 3% 19/5/2030	3.790.002	0,08	EUR 94.184.000	Spain Government Bond 2,8% 31/5/2026	93.014.234	1,97
		18.505.816	0,39	EUR 81.415.000	Spain Government Bond 3,55% 31/10/2033	81.765.492	1,73
	Portugal					497.615.119	10,50
EUR 109.780	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 5,887% 25/1/2035	108.172	0,00	EUR 10.000.000	Lansforsakringar Bank 0,875% 25/9/2023	9.981.900	0,21
EUR 713.570	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 7,887% 25/1/2035	699.710	0,02	EUR 20.675.000	Skandinaviska Enskilda Banken 0,05% 1/7/2024	20.019.603	0,42
EUR 7.200.000	Banco BPI 0,25% 22/3/2024	7.053.768	0,15	EUR 11.800.000	Stadshypotek 0,125% 5/10/2026*	10.656.268	0,23
EUR 16.500.000	Banco Santander Totta 3,375% 19/4/2028	16.335.000	0,34	EUR 4.300.000	Stadshypotek 0,75% 1/11/2027	3.872.137	0,08
EUR 3.209.649	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos 0,7% 12/2/2024	3.176.722	0,07	EUR 21.161.000	Swedbank 0,3% 20/5/2027	18.970.837	0,40
EUR 687.541	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Ulisses Finance No. 2 6,462% 23/9/2038	645.326	0,01	EUR 12.259.000	Swedbank 1,5% 18/9/2028	12.271.259	0,26
EUR 143.558	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 4,582% 28/10/2040	140.510	0,00	EUR 4.825.000	Volvo Treasury 1,625% 18/9/2025	4.609.274	0,10
EUR 502.451	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 5,182% 28/10/2040	482.111	0,01	EUR 12.300.000	Volvo Treasury 2,125% 1/9/2024	12.060.519	0,25
		28.641.319	0,60			92.441.797	1,95
	Slovaquie				Suisse		
EUR 11.700.000	Vseobecna Uverova Banka 0,01% 23/6/2025	10.884.346	0,23	EUR 10.386.000	Credit Suisse 0,25% 1/9/2028	8.576.343	0,18
EUR 10.100.000	Vseobecna Uverova Banka 0,25% 26/3/2024	9.870.225	0,21	EUR 9.000.000	Credit Suisse 2,125% 31/5/2024	8.865.360	0,19
		20.754.571	0,44	EUR 10.300.000	Credit Suisse 5,5% 20/8/2026	10.644.679	0,23
	Espagne			EUR 13.926.000	UBS 0,25% 24/2/2028	11.687.883	0,25
EUR 155.202	Autonomia Spain 2019 4,592% 27/12/2035	154.345	0,00	EUR 3.865.000	UBS 0,65% 10/9/2029	3.113.479	0,06
EUR 103.468	Autonomia Spain 2019 4,992% 27/12/2035	102.697	0,00	EUR 15.000.000	UBS 4,663% 16/1/2026	15.018.150	0,32
				EUR 30.865.000	UBS 7,75% 1/3/2029	34.899.673	0,74
				EUR 1.317.000	Zuercher Kantonbank 2,02% 13/4/2028*	1.203.468	0,02
						94.009.035	1,99

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
	Royaume-Uni						
GBP 306.000	Atlas Funding 2021-1 6,674% 25/7/2058	357.469	0,01	GBP 1.045.000	Finsbury Square 6,247% 16/12/2067	1.181.490	0,02
GBP 100.000	Atlas Funding 2021-1 6,874% 25/7/2058	116.558	0,00	GBP 370.000	Finsbury Square 2021-2 6,397% 16/12/2071	417.955	0,01
GBP 3.886.216	Atlas Funding 2023-1 6,345% 20/1/2061	4.546.776	0,10	GBP 200.000	Finsbury Square 2021-2 6,697% 16/12/2071	220.121	0,00
GBP 1.346.000	Atlas Funding 2023-1 7,095% 20/1/2061	1.567.918	0,03	GBP 625.612	Friary No 7 5,834% 21/10/2070	734.336	0,02
GBP 227.000	Atlas Funding 2023-1 7,945% 20/1/2061	263.739	0,01	GBP 487.000	Funding V 6,395% 15/10/2025	568.821	0,01
GBP 204.000	Atlas Funding 2023-1 8,995% 20/1/2061	237.350	0,01	GBP 115.000	Funding V 6,895% 15/10/2025	134.164	0,00
GBP 243.319	Azure Finance NO 2 8,195% 20/7/2030	284.895	0,01	GBP 5.441.000	Funding VIII 6,375% 15/5/2028	6.360.227	0,13
GBP 1.226.000	Barley Hill NO 2 6,595% 27/8/2058	1.398.882	0,03	GBP 1.009.000	Funding VIII 7,695% 15/5/2028	1.181.509	0,02
GBP 199.000	Barley Hill NO 2 6,895% 27/8/2058	223.524	0,00	GBP 147.000	Funding VIII 8,695% 15/5/2028	172.176	0,00
EUR 18.545.000	BAT International Finance 0,875% 13/10/2023	18.477.682	0,39	GBP 2.622.270	Gemgarto 2021-1 5,587% 16/12/2067	3.053.468	0,06
GBP 2.639.970	Brants Bridge 2022-1 6,208% 12/12/2064	3.093.424	0,07	GBP 218.000	Gemgarto 2021-1 6,297% 16/12/2067	250.071	0,01
GBP 2.097.879	Brass No 11 5,969% 16/11/2070	2.468.628	0,05	GBP 1.126.875	Greene King Finance 3,593% 15/3/2035	1.094.634	0,02
EUR 16.375.000	British Telecommunications 0,875% 26/9/2023	16.341.186	0,35	GBP 1.185.048	Greene King Finance 4,064% 15/3/2035	1.168.150	0,02
GBP 102.000	Canada Square Funding 2021-2 6,614% 17/6/2058	116.319	0,00	GBP 741.000	Harben Finance 6,242% 28/9/2055	826.175	0,02
GBP 318.000	Canada Square Funding 6 6,601% 17/1/2059	355.430	0,01	GBP 441.000	Harben Finance 6,592% 28/9/2055	474.919	0,01
GBP 178.000	Canada Square Funding 6 7,001% 17/1/2059	193.625	0,00	GBP 662.000	Hermitage 2023 7,646% 21/9/2033	774.216	0,02
GBP 400.000	Canary Wharf Finance II 6,684% 22/10/2037	380.532	0,01	GBP 2.774.000	Holmes Master Issuer 5,73% 15/10/2072	3.254.470	0,07
GBP 4.476.000	Canary Wharf Finance II 7,409% 22/10/2037	4.137.543	0,09	GBP 2.503.281	Hops Hill No 1 6,145% 27/5/2054	2.925.005	0,06
EUR 19.250.000	Chanel Ceres 0,5% 31/7/2026	17.321.439	0,37	GBP 345.980	Hops Hill No 1 6,795% 27/5/2054	403.212	0,01
EUR 3.375.000	Channel Link Enterprises Finance 2,706% 30/6/2050	3.085.273	0,07	GBP 199.992	Hops Hill No 1 7,045% 27/5/2054	233.098	0,00
GBP 2.350.000	Channel Link Enterprises Finance 3,043% 30/6/2050	2.293.736	0,05	GBP 99.998	Hops Hill No 1 7,545% 27/5/2054	115.149	0,00
GBP 1.433.563	CMF 2020-1 5,796% 16/1/2057	1.674.433	0,04	GBP 5.061.000	Hops Hill No 3 6,532% 21/12/2055	5.837.760	0,12
GBP 220.000	CMF 2020-1 6,196% 16/1/2057	256.695	0,01	GBP 692.000	Hops Hill No 3 7,332% 21/12/2055	792.746	0,02
GBP 105.000	CMF 2020-1 6,446% 16/1/2057	122.316	0,00	GBP 6.000.298	Hops Hill No2 6,495% 27/11/2054	7.047.959	0,15
GBP 4.794.000	Delamare Cards MTN Issuer 5,995% 19/4/2031	5.611.288	0,12	EUR 11.613.000	HSBC 4,787% 10/3/2032	11.669.419	0,25
GBP 582.174	Dignity Finance 3,546% 31/12/2034	599.560	0,01	EUR 3.813.000	HSBC 6,364% 16/11/2032	3.907.581	0,08
GBP 190.000	Dignity Finance 4,696% 31/12/2049	140.306	0,00	GBP 2.463.104	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 6,058% 12/6/2057	2.882.235	0,06
GBP 1.600.000	Dowson 2021-2 6,395% 20/10/2028	1.869.861	0,04	GBP 630.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 6,808% 12/6/2057	735.952	0,02
GBP 1.300.000	Dowson 2021-2 6,795% 20/10/2028	1.515.905	0,03	GBP 370.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7,208% 12/6/2057	429.381	0,01
GBP 1.977.000	Dowson 2022-1 6,945% 20/1/2029	2.314.431	0,05	GBP 266.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,109% 20/7/2058	302.962	0,01
GBP 293.000	Dowson 2022-1 7,445% 20/1/2029	340.373	0,01	GBP 158.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,409% 20/7/2058	177.371	0,00
GBP 153.000	Dowson 2022-1 7,895% 20/1/2029	175.612	0,00	GBP 103.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,809% 20/7/2058	113.624	0,00
GBP 1.132.028	E-Carat 12 5,565% 18/8/2029	1.322.297	0,03	GBP 205.000	London Cards NO 1 8,945% 15/5/2033	238.818	0,01
GBP 4.093.000	Economic Master Issuer 5,496% 25/6/2073	4.766.455	0,10	GBP 2.000.000	Mitchells & Butlers Finance 6,469% 15/9/2030	2.055.350	0,04
GBP 2.064.075	Economic Master Issuer 5,756% 25/6/2074	2.418.362	0,05	GBP 805.000	Mitchells & Butlers Finance 7,347% 15/6/2036	762.836	0,02
GBP 811.801	Elvet Mortgages 2020-1 5,892% 22/3/2065	951.630	0,02	GBP 4.548.329	Mortimer BTL 2021-1 5,733% 23/6/2053	5.260.713	0,11
GBP 1.642.138	Elvet Mortgages 2021-1 5,54% 22/10/2063	1.920.135	0,04				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
GBP 334.000	Mortimer BTL 2021-1 6,133% 23/6/2053	383.250	0,01	USD 6.055.000	Standard Chartered 1,214% 23/3/2025*	5.412.712	0,12
GBP 108.000	Mortimer BTL 2021-1 6,483% 23/6/2053	121.823	0,00	GBP 1.107.883	Stanlington No 2 5,908% 12/6/2045	1.290.479	0,03
EUR 9.225.000	National Grid 3,875% 16/1/2029	9.160.010	0,19	GBP 2.261.000	Stanlington No 2 6,458% 12/6/2045	2.613.499	0,06
EUR 3.495.000	Nationwide Building Society 2% 25/7/2029	3.398.625	0,07	GBP 905.753	Tesco Property Finance 1 7,623% 13/7/2039	1.130.692	0,02
EUR 4.391.000	NatWest 0,75% 15/11/2025	4.203.240	0,09	GBP 1.806.772	Tesco Property Finance 3 5,744% 13/4/2040	1.964.428	0,04
EUR 5.759.000	NatWest 1,75% 2/3/2026	5.523.313	0,12	GBP 1.020.720	Tesco Property Finance 4 5,801% 13/10/2040	1.116.493	0,02
GBP 3.121.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6,165% 15/3/2029	3.645.533	0,08	EUR 22.110.000	Thames Water Utilities Finance 4% 18/4/2027	21.170.325	0,45
GBP 775.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6,745% 15/3/2029	902.903	0,02	GBP 157.000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6,087% 12/7/2063	179.590	0,00
GBP 677.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6,545% 15/11/2029	781.970	0,02	GBP 107.000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6,387% 12/7/2063	120.696	0,00
GBP 1.296.000	Newday Partnership Master Issuer 7,986% 15/7/2031	1.521.820	0,03	GBP 4.898.177	Tower Bridge Funding 2021-1 6,064% 21/7/2064	5.722.538	0,12
EUR 169.665	Newgate Funding 3,754% 1/12/2050	157.753	0,00	GBP 381.999	Tower Bridge Funding 2021-1 6,664% 21/7/2064	445.811	0,01
EUR 17.800.000	NGG Finance 1,625% 5/12/2079	16.974.240	0,36	GBP 364.999	Tower Bridge Funding 2021-1 7,014% 21/7/2064	424.700	0,01
GBP 1.360.000	Oat Hill NO 3 6,885% 29/5/2046	1.552.808	0,03	GBP 253.000	Tower Bridge Funding 2021-1 7,314% 21/7/2064	292.873	0,01
GBP 698.000	Oat Hill NO 3 7,685% 29/5/2046	792.249	0,02	GBP 2.005.490	Tower Bridge Funding 2021-2 5,998% 20/11/2063	2.331.573	0,05
GBP 228.548	Paragon Mortgages No 26 6,268% 15/5/2045	267.264	0,01	GBP 140.999	Tower Bridge Funding 2021-2 6,718% 20/11/2063	161.172	0,00
GBP 1.064.144	Parkmore Point RMBS 2022-1 6,673% 25/7/2045	1.232.826	0,03	GBP 168.999	Tower Bridge Funding 2021-2 7,018% 20/11/2063	188.405	0,00
GBP 2.165.000	Polaris 2023-1 7,947% 23/2/2061	2.549.797	0,05	GBP 264.000	Tower Bridge Funding 2022-1 6,275% 20/12/2063	297.142	0,01
GBP 375.000	Polaris 2023-1 8,847% 23/2/2061	440.440	0,01	GBP 2.666.407	Tower Bridge Funding 2023-1 6,659% 20/10/2064	3.135.505	0,07
GBP 283.000	Polaris 2023-1 9,547% 23/2/2061	329.764	0,01	GBP 225.000	Tower Bridge Funding 2023-1 7,359% 20/10/2064	263.218	0,01
GBP 2.155.994	Precise Mortgage Funding 2019-1B 6,158% 12/12/2055	2.523.559	0,05	GBP 172.000	Tower Bridge Funding 2023-1 8,309% 20/10/2064	201.736	0,00
GBP 115.000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6,646% 16/10/2056	133.961	0,00	GBP 193.000	Tower Bridge Funding 2023-1 9,459% 20/10/2064	225.071	0,00
GBP 100.000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6,896% 16/10/2056	116.403	0,00	GBP 765.000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	898.521	0,02
GBP 100.000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 7,146% 16/10/2056	114.637	0,00	GBP 145.000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	169.939	0,00
GBP 3.064.198	Premiertel 6,175% 8/5/2032	3.269.948	0,07	GBP 234.000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	274.145	0,01
GBP 2.815.044	Residential Mortgage 32 6,275% 20/6/2070	3.293.016	0,07	GBP 1.590.000	Turbo Finance 9 6,845% 20/8/2028	1.863.682	0,04
GBP 525.000	Residential Mortgage 32 7,225% 20/6/2070	611.294	0,01	GBP 1.772.000	Twin Bridges 5,721% 14/6/2055	2.068.802	0,04
EUR 1.478.078	RMAC No 1 3,736% 12/6/2044	1.398.690	0,03	GBP 452.000	Twin Bridges 7,271% 14/6/2055	522.303	0,01
GBP 3.345.000	Sage AR Funding No 1 6,469% 17/11/2030	3.828.412	0,08	GBP 435.000	Twin Bridges 8,271% 14/6/2055	508.016	0,01
GBP 915.000	Sage AR Funding No 1 7,169% 17/11/2030	1.031.668	0,02	GBP 1.203.040	Twin Bridges 2020-1 6,208% 12/12/2054	1.409.952	0,03
GBP 535.000	Sage AR Funding No 1 7,369% 17/11/2030	589.947	0,01	GBP 390.000	Twin Bridges 2020-1 7,208% 12/12/2054	455.813	0,01
EUR 8.875.000	Santander UK 0,1% 12/5/2024	8.645.004	0,18	GBP 225.000	Twin Bridges 2020-1 7,958% 12/12/2054	262.167	0,01
EUR 6.900.000	Santander UK 0,603% 13/9/2029	5.603.180	0,12	GBP 3.300.541	Twin Bridges 2021-1 5,808% 12/3/2055	3.846.353	0,08
EUR 4.500.000	Santander UK 3,53% 25/8/2028	4.305.476	0,09	GBP 1.310.000	Twin Bridges 2021-1 6,358% 12/3/2055	1.521.905	0,03
GBP 122.000	Satus 2021-1 7,096% 17/8/2028	139.787	0,00				
GBP 247.000	Satus 2021-1 8,396% 17/8/2028	285.714	0,01				
EUR 10.292.000	SSE 4% 21/1/2028	9.520.728	0,20				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Euro Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
GBP 436.000	Twin Bridges 2021-1 6,558% 12/3/2055	498.616	0,01	USD 9.505.000	Enel Finance America 7,1% 14/10/2027*	9.145.283	0,19
GBP 220.000	Twin Bridges 2021-1 7,058% 12/3/2055	249.434	0,01	EUR 12.083.000	Fidelity National Information Services 0,625% 3/12/2025	11.245.044	0,24
GBP 435.000	Twin Bridges 2021-2 6,108% 12/9/2055	487.111	0,01	EUR 6.000.000	Goldman Sachs 1,375% 15/5/2024	5.886.810	0,12
GBP 187.000	Twin Bridges 2021-2 6,458% 12/9/2055	205.086	0,00	EUR 12.500.000	Goldman Sachs 4,214% 30/4/2024	12.506.875	0,26
GBP 2.097.000	Twin Bridges 2022-1 5,958% 1/12/2055	2.384.687	0,05	EUR 23.810.000	International Business Machines 3,375% 6/2/2027	23.552.441	0,50
GBP 536.277	Unique Pub Finance 5,659% 30/6/2027	618.809	0,01	EUR 8.375.000	Kraft Heinz Foods 4,254% 9/5/2025*	8.395.142	0,18
GBP 750.410	Unique Pub Finance 7,395% 28/3/2024	872.006	0,02	EUR 15.000.000	Morgan Stanley 0,495% 26/10/2029	12.416.676	0,26
		338.176.717	7,14	USD 4.100.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	3.490.569	0,07
États-Unis				EUR 10.935.000	Verizon Communications 0,375% 22/3/2029	9.009.670	0,19
EUR 5.854.000	American Tower 0,45% 15/1/2027	5.145.256	0,11	EUR 3.000.000	Verizon Communications 1,25% 8/4/2030	2.520.745	0,05
EUR 6.583.000	American Tower 4,125% 16/5/2027	6.549.493	0,14			171.217.506	3,61
EUR 5.000.000	Bank of America 0,583% 24/8/2028	4.345.200	0,09	Total des obligations		4.649.248.520	98,09
EUR 2.700.000	Bank of America 2,824% 27/4/2033	2.414.523	0,05	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
EUR 8.450.000	Bank of America 4,134% 12/6/2028	8.441.972	0,18	Total du portefeuille		4.649.248.520	98,09
EUR 26.275.000	Bank of America 4,587% 22/9/2026	26.268.694	0,56	Autres éléments de l'actif net		90.317.090	1,91
EUR 11.790.000	BAT Capital 1,125% 16/11/2023	11.714.249	0,25	Total de l'actif net (EUR)		4.739.565.610	100,00
EUR 8.800.000	Becton Dickinson 0,034% 13/8/2025	8.168.864	0,17				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
CAD	15.570.000	USD	11.836.974	Bank of America	20/9/2023	(299.476)
EUR	3.625.483	NOK	41.900.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(168)
EUR	198.733.890	GBP	170.620.000	JP Morgan	17/10/2023	(226.579)
EUR	8.163.979	NZD	14.370.000	Deutsche Bank	17/10/2023	302.532
EUR	21.123.806	USD	23.740.000	Standard Chartered Bank	17/10/2023	(711.284)
EUR	2.270.912	GBP	1.960.000	State Street	17/10/2023	(14.650)
EUR	3.413.141	GBP	2.970.000	Deutsche Bank	17/10/2023	(50.184)
EUR	3.678.280	NOK	41.100.000	Deutsche Bank	20/9/2023	121.853
EUR	3.367.960	HUF	1.328.000.000	Société Générale	20/9/2023	(109.805)
EUR	3.882.268	HUF	1.505.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(59.024)
GBP	2.860.000	USD	3.700.077	Barclays	20/9/2023	(68.459)
GBP	6.080.000	USD	7.799.815	Morgan Stanley	20/9/2023	(84.675)
HUF	4.178.000.000	EUR	10.733.309	Deutsche Bank	20/9/2023	208.032
HUF	1.371.000.000	EUR	3.514.069	JP Morgan	20/9/2023	76.304
HUF	1.456.000.000	EUR	3.660.683	BNP Paribas	20/9/2023	152.288
JPY	6.119.000.000	USD	42.726.213	Bank of America	20/9/2023	(692.875)
JPY	2.266.000.000	USD	16.286.075	BNP Paribas	20/9/2023	(683.577)
JPY	618.000.000	USD	4.270.172	Morgan Stanley	20/9/2023	(28.494)
NOK	83.000.000	EUR	7.059.951	Goldman Sachs	20/9/2023	122.126
NOK	41.500.000	USD	3.866.241	Deutsche Bank	20/9/2023	30.262
NOK	41.200.000	USD	3.833.788	Goldman Sachs	20/9/2023	34.192
NZD	18.820.000	USD	11.734.835	Morgan Stanley	20/9/2023	(498.464)
NZD	19.080.000	USD	11.860.109	Toronto-Dominion	20/9/2023	(471.418)
NZD	6.030.000	USD	3.702.330	HSBC Bank	20/9/2023	(106.701)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro Short Duration Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
USD	7.876.532	GBP	6.260.000	JP Morgan	20/9/2023	(54.834)
USD	3.922.042	GBP	3.070.000	Morgan Stanley	20/9/2023	27.695
USD	4.038.218	GBP	3.160.000	Bank of America	20/9/2023	29.611
USD	3.342.752	GBP	2.630.000	Barclays	20/9/2023	7.910
USD	8.031.641	NOK	82.700.000	Deutsche Bank	20/9/2023	240.958
USD	4.472.330	JPY	618.000.000	Barclays	20/9/2023	214.680
USD	3.927.289	JPY	538.000.000	BNP Paribas	20/9/2023	218.113
USD	11.986.910	NZD	18.820.000	Morgan Stanley	20/9/2023	730.623
USD	11.813.362	CAD	15.570.000	Morgan Stanley	20/9/2023	277.730
USD	7.791.060	GBP	6.000.000	HSBC Bank	20/9/2023	170.018
USD	3.774.947	NZD	6.090.000	HSBC Bank	20/9/2023	140.715
USD	3.908.879	JPY	558.750.000	UBS	20/9/2023	70.066
USD	11.753.227	JPY	1.676.250.000	Bank of America	20/9/2023	234.688
USD	3.806.905	GBP	3.000.000	BNP Paribas	20/9/2023	3.386
USD	11.635.980	EUR	10.640.000	Barclays	20/9/2023	76.642
Moins-value nette non réalisée						(670.243)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	21.359.574	EUR	22.293.364	BNY Mellon	15/9/2023	11.974
EUR	341.895	CHF	327.796	BNY Mellon	15/9/2023	(415)
Plus-value nette non réalisée						11.559
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	62.803	GBP	54.203	BNY Mellon	15/9/2023	(499)
GBP	11.195.911	EUR	12.985.081	BNY Mellon	15/9/2023	89.955
Plus-value nette non réalisée						89.456
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	198.462	USD	217.368	BNY Mellon	15/9/2023	(1.781)
USD	58.117.469	EUR	52.971.088	BNY Mellon	15/9/2023	567.885
Plus-value nette non réalisée						566.104
Total des moins-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 760.898.605)						(3.124)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
(3.520)	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	408.425.600	587.687
(648)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	86.184.000	(354.125)
79	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	10.543.340	(130.440)
11.168	EUR	Euro Schatz	Septembre 2023	1.173.700.960	(1.694.618)
(457)	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	52.970.870	(208.929)
(608)	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	77.647.680	226.063
(36)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	33.361.895	329.901
(473)	EUR	3 Month EURIBOR	Septembre 2023	113.744.675	(17.737)
2.684	EUR	Short-Term Euro-BTP	Septembre 2023	282.517.840	(426.645)
274	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	28.005.129	232.286
136	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	14.538.868	169.359
(3)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	357.996	(5.262)
122	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	13.588.796	95.832
(58)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	10.888.078	(26.004)
266	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	26.185.697	168.599
Total				2.332.661.424	(1.054.033)

Euro Short Duration Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR 7.000.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2023	(112.900)	(14.251)
CDS	EUR 9.730.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2023	(75.288)	(19.810)
CDS	EUR 5.000.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2023	(80.804)	(10.180)
CDS	EUR 8.000.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2023	(120.209)	(16.287)
CDS	EUR 8.270.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2023	(70.591)	(16.837)
CDS	EUR 62.524.000	Fund receives default protection on ITRAXX.EUR.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(211.258)	(820.206)
IFS	EUR 1.775.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,403%	Goldman Sachs	15/5/2028	11.428	11.428
IFS	EUR 49.000.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,56%	Goldman Sachs	15/6/2028	41.591	41.591
IFS	EUR 50.185.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,46%	Goldman Sachs	15/7/2028	197.783	197.783
IFS	EUR 2.970.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,434%	Goldman Sachs	15/5/2033	(30.233)	(30.232)
IFS	EUR 600.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,456%	Goldman Sachs	15/5/2033	(4.863)	(4.863)
IFS	EUR 24.220.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,435%	Goldman Sachs	15/5/2033	236.647	244.261
IFS	EUR 1.495.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,4365%	Goldman Sachs	15/5/2033	14.866	14.866
IFS	EUR 47.170.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,555%	Goldman Sachs	15/6/2033	(35.587)	(35.587)
IFS	EUR 50.500.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,505%	Goldman Sachs	15/7/2033	(197.186)	(197.186)
IFS	EUR 1.510.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,6015%	Goldman Sachs	15/5/2043	(14.878)	(14.878)
IFS	EUR 14.084.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,5737%	Goldman Sachs	15/5/2038	(63.555)	(63.555)
IFS	EUR 24.475.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,60125%	Goldman Sachs	15/5/2043	(258.812)	(242.282)
IRS	KRW 66.142.140.000	Fund receives Fixed 1,632%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	21/9/2023	(55.685)	(55.685)
IRS	BRL 9.700.000	Fund receives Fixed 9,94%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(18.972)	(18.972)
IRS	KRW 79.370.550.000	Fund receives Fixed 1,59%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	21/9/2023	(68.147)	(68.147)
IRS	KRW 32.145.065.200	Fund receives Fixed 1,63%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	21/9/2023	(27.088)	(27.088)
IRS	BRL 19.390.000	Fund receives Fixed 10,11%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(21.088)	(21.088)
IRS	GBP 85.740.000	Fund receives Fixed 5,795%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Goldman Sachs	17/8/2025	504.031	504.031
IRS	KRW 38.657.010.000	Fund receives Fixed 3,645%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Goldman Sachs	25/8/2026	35.036	35.036
IRS	EUR 31.700.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 3,109%	Goldman Sachs	28/6/2032	(137.999)	(137.999)
IRS	EUR 58.610.000	Fund receives Fixed 2,78%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Goldman Sachs	1/8/2033	(51.422)	(26.560)
IRS	EUR 31.420.000	Fund receives Fixed 3%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Goldman Sachs	17/8/2033	279.549	260.066
IRS	EUR 26.495.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,8133%	Goldman Sachs	15/8/2048	124.779	124.779
IRS	KRW 33.997.044.800	Fund receives Fixed 1,6425%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	HSBC Bank	21/9/2023	(28.480)	(28.480)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 743.675.228)					(239.335)	(436.332)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Euro-Markets Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Belgique				Irlande			
687.998	Azelis	13.925.079	1,09	4.667.426	AIB	19.631.194	1,53
				106.033	Linde	37.998.868	2,97
				57.630.062 4,50			
Danemark				Italie			
168.080	DSV	29.288.253	2,29	1.110.264	FinecoBank Banca Fineco	14.155.866	1,11
				305.473	Moncler	19.312.003	1,51
				1.745.520	UniCredit	39.719.307	3,10
				73.187.176 5,72			
Finlande				Pays-Bas			
2.070.376	Metso*	22.277.246	1,74	2.892	Adyen	2.253.157	0,17
				86.303	ASM International	38.758.677	3,03
France				167.132	ASML	102.602.335	8,02
572.699	ALD	5.142.837	0,40	197.057	BE Semiconductor Industries*	21.163.922	1,66
672.733	BNP Paribas	40.397.616	3,16	98.023	Ferrari	28.975.599	2,27
123.797	Capgemini	21.534.488	1,68	254.876	Heineken*	23.127.448	1,81
15.722	Hermes International	30.145.363	2,36	236.803	IMCD	30.298.944	2,37
248.514	Legrand	22.758.912	1,78	341.252	QIAGEN	14.455.435	1,13
43.409	L'Oreal	17.815.054	1,40	721.396	STMicroelectronics	31.694.533	2,48
131.692	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	104.563.448	8,17	293.330.050 22,94			
170.468	Pernod Ricard*	31.374.635	2,45	Espagne			
288.056	Safran	43.041.327	3,37	5.170.500	CaixaBank*	19.554.831	1,53
294.308	Sanofi	29.286.589	2,29	Suède			
75.046	Sartorius Stedim Biotech	19.707.080	1,54	1.222.535	Beijer Ref*	12.993.902	1,01
346.641	Schneider Electric	55.282.307	4,32	Royaume-Uni			
439.843	TotalEnergies*	25.590.066	2,00	1.093.429	Allfunds	5.986.524	0,47
352.025	Vinci	36.483.871	2,85	686.502	RELX	20.710.453	1,62
483.123.593 37,77				26.696.977 2,09			
Allemagne				Total des actions ordinaires 1.255.388.580 98,14			
471.673	AIXTRON*	16.584.023	1,30	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé 1.255.388.580 98,14			
1.610.399	Commerzbank	16.434.122	1,28	Total du portefeuille 1.255.388.580 98,14			
175.856	CTS Eventim*	10.111.720	0,79	Autres éléments de l'actif net 23.851.428 1,86			
131.808	Merck	21.998.755	1,72	Total de l'actif net (EUR) 1.279.240.008 100,00			
152.949	MTU Aero Engines	33.189.933	2,60				
444.474	SAP*	57.772.730	4,51				
346.440	Siemens	48.272.950	3,77				
196.743	Symrise	19.017.178	1,49				
223.381.411 17,46							

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Euro-Markets Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	17.533.270	EUR	18.300.415	BNY Mellon	15/9/2023	9.199
EUR	1.070.235	CHF	1.024.047	BNY Mellon	15/9/2023	843
Plus-value nette non réalisée						10.042
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	228.037	GBP	195.682	BNY Mellon	15/9/2023	(488)
GBP	2.969.436	EUR	3.444.086	BNY Mellon	15/9/2023	23.741
Plus-value nette non réalisée						23.253
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
EUR	32.378	HKD	276.441	BNY Mellon	15/9/2023	(109)
HKD	4.941.292	EUR	577.076	BNY Mellon	15/9/2023	3.626
Plus-value nette non réalisée						3.517
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
EUR	27.630	SGD	40.849	BNY Mellon	15/9/2023	(223)
SGD	727.397	EUR	492.538	BNY Mellon	15/9/2023	3.442
Plus-value nette non réalisée						3.219
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	2.775.085	USD	3.030.748	BNY Mellon	15/9/2023	(16.894)
USD	46.377.644	EUR	42.277.911	BNY Mellon	15/9/2023	446.097
Plus-value nette non réalisée						429.203
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 69.743.791)						469.234

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Valeurs industrielles	23,73
Technologie	22,68
Biens de consommation cyclique	18,56
Biens de consommation non cyclique	15,00
Finance	11,71
Matériaux de base	4,46
Énergie	2,00
Autres éléments de l'actif net	1,86
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

European Equity Income Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Belgique				Italie			
736.960	Azelis	14.916.070	0,95	1.661.100	UniCredit*	37.798.331	2,41
Danemark				Jersey			
216.647	Carlsberg	29.363.615	1,87	950.758	Experian	30.915.391	1,98
448.788	Novo Nordisk	76.955.488	4,92	Pays-Bas			
2.996.527	Tryg	52.818.218	3,37	80.234	ASML	49.255.653	3,15
				770.504	ASR Nederland*	31.398.038	2,00
				826.161	STMicroelectronics	36.297.384	2,32
				116.951.075			
				7,47			
				Espagne			
				522.268	Industria de Diseno Textil	18.566.627	1,19
				Suède			
Finlande				583.118	Alfa Laval	19.016.973	1,21
1.458.594	Sampo	59.510.635	3,80	1.396.052	Epiroc	24.840.343	1,59
1.088.799	UPM-Kymmene*	34.602.032	2,21	4.622.626	Tele2*	30.283.926	1,94
				1.570.961	Volvo*	29.465.649	1,88
				103.606.891			
				6,62			
France				Suisse			
746.561	ALD	6.704.118	0,43	84.660	Lonza	43.432.897	2,77
551.439	BNP Paribas	33.113.912	2,11	643.643	Nestle	71.696.987	4,58
756.078	Cie de Saint-Gobain	45.387.362	2,90	164.540	Roche	45.014.250	2,88
2.290.887	Engie	34.267.088	2,19	114.534	Sika*	30.001.074	1,92
45.958	L'Oreal	18.861.163	1,21	70.008	Zurich Insurance	30.436.562	1,94
44.928	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	35.672.832	2,28	220.581.770			
645.560	Sanofi	64.239.676	4,10	14,09			
200.249	Schneider Electric	31.935.710	2,04	Royaume-Uni			
245.243	Thales*	33.242.689	2,12	510.371	AstraZeneca	64.127.981	4,10
585.128	Vinci	60.642.666	3,88	270.418	BP	1.549.608	0,10
				5.865.789	Haleon*	22.291.295	1,42
				3.977.738	Phoenix*	24.093.102	1,54
				1.056.889	RELX	31.884.320	2,04
				1.468.433	Shell	41.511.776	2,65
				185.458.082			
				11,85			
				Total des actions ordinaires			
				1.550.615.095			
				99,05			
Allemagne				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
99.550	Merck	16.614.895	1,06	1.550.615.095			
127.737	MTU Aero Engines	27.718.929	1,77	99,05			
701.183	RWE*	26.855.309	1,71	Total du portefeuille			
261.243	SAP	33.956.365	2,17	1.550.615.095			
241.112	Siemens*	33.596.546	2,15	99,05			
				138.742.044			
				8,86			
Irlande				Autres éléments de l'actif net			
586.117	CRH	31.204.869	1,99	14.866.276			
96.428	Linde	34.556.741	2,21	Total de l'actif net (EUR)			
				1.565.481.371			
				100,00			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

European Equity Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	53.785.768	EUR	31.929.605	BNY Mellon	15/9/2023	178.370
EUR	1.437.153	AUD	2.435.088	BNY Mellon	15/9/2023	(16.500)
Plus-value nette non réalisée						161.870
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	6.825.258	EUR	4.626.335	BNY Mellon	15/9/2023	22.052
EUR	155.825	CAD	229.750	BNY Mellon	15/9/2023	(649)
Plus-value nette non réalisée						21.403
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	8.945.145	EUR	1.129.921	BNY Mellon	15/9/2023	3.370
EUR	115.421	CNY	912.495	BNY Mellon	15/9/2023	(186)
Plus-value nette non réalisée						3.184
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	1.531.506	GBP	1.315.615	BNY Mellon	15/9/2023	(4.921)
GBP	27.101.077	EUR	31.437.639	BNY Mellon	15/9/2023	212.087
Plus-value nette non réalisée						207.166
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
EUR	2.084.691	HKD	17.801.318	BNY Mellon	15/9/2023	(7.325)
HKD	446.473.152	EUR	52.142.724	BNY Mellon	15/9/2023	326.948
Plus-value nette non réalisée						319.623
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
EUR	171.636	NZD	315.029	BNY Mellon	15/9/2023	(972)
NZD	8.832.465	EUR	4.863.287	BNY Mellon	15/9/2023	(23.934)
Moins-value nette non réalisée						(24.906)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
EUR	3.751.112	SGD	5.547.614	BNY Mellon	15/9/2023	(31.565)
SGD	144.724.363	EUR	98.002.413	BNY Mellon	15/9/2023	678.859
Plus-value nette non réalisée						647.294
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	7.563.674	USD	8.255.629	BNY Mellon	15/9/2023	(41.556)
USD	194.087.571	EUR	176.928.149	BNY Mellon	15/9/2023	1.869.183
Plus-value nette non réalisée						1.827.627
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 421.374.893)						3.163.261

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	33,36
Valeurs industrielles	21,57
Finance	17,17
Technologie	7,64
Biens de consommation cyclique	6,30
Matériaux de base	4,42
Services aux collectivités	3,90
Énergie	2,75
Communications	1,94
Autres éléments de l'actif net	0,95
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

European Focus Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
EUR	458	SGD	676	BNY Mellon	15/9/2023	(3)
SGD	11.522	EUR	7.802	BNY Mellon	15/9/2023	54
Plus-value nette non réalisée						51
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	341.274	USD	372.020	BNY Mellon	15/9/2023	(1.437)
USD	5.923.288	EUR	5.400.048	BNY Mellon	15/9/2023	56.603
Plus-value nette non réalisée						55.166
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 5.810.980)						55.217

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	29,13
Valeurs industrielles	20,98
Biens de consommation cyclique	16,32
Technologie	14,35
Finance	9,57
Matériaux de base	3,99
Communications	0,97
Autres éléments de l'actif net	4,69
	100,00

European Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				104.757	ASML	64.310.322	4,81		
				399.432	BE Semiconductor Industries	42.898.997	3,21		
				134.865	Ferrari*	39.866.094	2,98		
				261.429	IMCD*	33.449.841	2,50		
				1.196.283	STMicroelectronics	52.558.694	3,93		
ACTIONS ORDINAIRES						276.421.276	20,67		
Belgique				Espagne					
300.731	KBC*	18.266.401	1,37	5.665.424	CaixaBank	21.426.634	1,60		
Danemark				Suède					
265.469	DSV*	46.258.468	3,46	1.648.630	Atlas Copco	20.280.666	1,52		
67.738	Genmab	24.179.620	1,81	1.038.980	Epiroc	18.486.861	1,38		
649.921	Novo Nordisk	111.444.574	8,33						
426.914	Royal Unibrew*	34.545.635	2,58						
		216.428.297	16,18			38.767.527	2,90		
France				Suisse					
392.357	BNP Paribas	23.561.038	1,76	99.555	Lonza*	51.074.439	3,82		
579.286	Cie de Saint-Gobain	34.774.538	2,60	23.601	Partners	23.457.323	1,75		
17.800	Hermes International	34.129.720	2,55	143.615	Sika*	37.618.561	2,81		
79.964	L'Oreal*	32.817.225	2,45	109.336	Straumann*	15.346.669	1,15		
110.221	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	87.515.474	6,55			127.496.992	9,53		
83.372	Pernod Ricard	15.344.617	1,15	Royaume-Uni					
47.850	Sartorius Stedim Biotech	12.565.410	0,94	1.558.403	Allfunds	8.532.256	0,64		
271.910	Schneider Electric	43.364.207	3,24	503.027	Ashtead	32.689.918	2,44		
		284.072.229	21,24	1.826.472	Auto Trader	12.996.364	0,97		
Allemagne				14.121.465	JD Sports Fashion	24.147.047	1,81		
190.868	MTU Aero Engines*	41.418.356	3,10	1.519.039	RELX	45.826.502	3,43		
				94.852	Spirax-Sarco Engineering*	11.265.369	0,84		
Irlande						135.457.456	10,13		
8.104.170	AIB	34.086.139	2,55	Total des actions ordinaires			1.282.226.128	95,87	
372.712	Kingspan	28.996.994	2,17	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				1.282.226.128	95,87
147.250	Linde	52.769.735	3,94	Total du portefeuille				1.282.226.128	95,87
		115.852.868	8,66	Autres éléments de l'actif net				55.203.360	4,13
Italie				Total de l'actif net (EUR)				1.337.429.488	100,00
519.066	FinecoBank Banca Fineco	6.618.092	0,49						
Pays-Bas									
9.415	Adyen	7.335.226	0,55						
80.165	ASM International*	36.002.102	2,69						

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

European Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	3.945.489	EUR	2.342.047	BNY Mellon	15/9/2023	13.256
EUR	137.554	AUD	233.009	BNY Mellon	15/9/2023	(1.545)
Plus-value nette non réalisée						11.711
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	1.106.843	EUR	750.201	BNY Mellon	15/9/2023	3.622
EUR	44.266	CAD	65.235	BNY Mellon	15/9/2023	(164)
Plus-value nette non réalisée						3.458
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	1.973.419	EUR	249.424	BNY Mellon	15/9/2023	595
EUR	11.350	CNY	90.115	BNY Mellon	15/9/2023	(67)
Plus-value nette non réalisée						528
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	263.259	GBP	225.648	BNY Mellon	15/9/2023	(261)
GBP	2.969.494	EUR	3.444.166	BNY Mellon	15/9/2023	23.728
Plus-value nette non réalisée						23.467
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
EUR	837.462	HKD	7.137.972	BNY Mellon	15/9/2023	(1.395)
HKD	98.956.463	EUR	11.557.452	BNY Mellon	15/9/2023	71.943
Plus-value nette non réalisée						70.548
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
EUR	43.058	NZD	78.951	BNY Mellon	15/9/2023	(199)
NZD	1.234.890	EUR	679.828	BNY Mellon	15/9/2023	(3.226)
Moins-value nette non réalisée						(3.425)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
EUR	1.032.426	SGD	1.525.297	BNY Mellon	15/9/2023	(7.608)
SGD	26.227.051	EUR	17.759.297	BNY Mellon	15/9/2023	123.792
Plus-value nette non réalisée						116.184
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	7.504.901	USD	8.171.718	BNY Mellon	15/9/2023	(23.016)
USD	86.828.381	EUR	79.158.960	BNY Mellon	15/9/2023	829.066
Plus-value nette non réalisée						806.050
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 126.965.676)						1.028.521

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	29,29
Valeurs industrielles	21,12
Biens de consommation cyclique	16,39
Technologie	14,64
Finance	9,52
Matériaux de base	3,94
Communications	0,97
Autres éléments de l'actif net	4,13
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

European High Yield Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				EUR 516.000	Crown European 5% 15/5/2028	519.429	0,16
COMPARTIMENTS				EUR 800.000	Electricite de France 2,875% 15/12/2026*	702.000	0,22
Irlande				EUR 3.200.000	Electricite de France 3,375% 15/6/2030	2.492.800	0,78
51.498	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund~	5.169.738	1,61	EUR 600.000	Electricite de France 4% 4/7/2024	583.650	0,18
Total des Compartiments		5.169.738	1,61	EUR 900.000	Electricite de France 5,375% 29/1/2025	878.625	0,27
ACTIONS ORDINAIRES				GBP 300.000	Electricite de France 6% 29/1/2026	325.458	0,10
Luxembourg				EUR 200.000	Electricite de France 7,5% 6/9/2028	205.700	0,07
104.182	ADLER	53.237	0,01	EUR 1.068.000	Elior 3,75% 15/7/2026*	850.940	0,26
Total des actions ordinaires		53.237	0,01	EUR 1.300.000	Eutelsat 1,5% 13/10/2028*	993.244	0,31
OBLIGATIONS				EUR 300.000	Eutelsat 2% 2/10/2025*	275.473	0,09
Autriche				EUR 1.300.000	Forvia 2,75% 15/2/2027	1.186.900	0,37
EUR 800.000	ams-OSRAM 0% 5/3/2025	671.788	0,21	EUR 563.000	Forvia 3,75% 15/6/2028*	515.587	0,16
Belgique				EUR 1.190.000	Forvia 7,25% 15/6/2026	1.238.814	0,39
EUR 441.000	Azelis Finance 5,75% 15/3/2028*	449.558	0,14	EUR 2.099.000	Goldstory 5,375% 1/3/2026*	2.029.250	0,63
EUR 600.000	KBC 4,75% 5/3/2024	592.650	0,19	EUR 2.500.000	iliad 5,375% 14/6/2027	2.481.325	0,77
		1.042.208	0,33	EUR 500.000	iliad 5,625% 15/2/2030*	487.000	0,15
Îles Vierges britanniques				EUR 400.000	Iliad 5,625% 15/10/2028*	377.588	0,12
EUR 527.000	Global Switch 2,25% 31/5/2027	490.569	0,15	EUR 900.000	La Financiere Atalian 5,125% 15/5/2025	618.318	0,19
Chypre				GBP 300.000	La Financiere Atalian 6,625% 15/5/2025	241.859	0,07
EUR 500.000	Bank of Cyprus 2,5% 24/6/2027	446.100	0,14	EUR 200.000	Loxam 5,75% 15/7/2027*	185.860	0,06
Finlande				EUR 800.000	Loxam 6,375% 15/5/2028*	794.468	0,25
EUR 670.000	Ahlstrom 3 Oy 3,625% 4/2/2028	561.694	0,18	EUR 700.000	Novafives 5% 15/6/2025	661.843	0,21
USD 387.000	Ahlstrom 3 Oy 4,875% 4/2/2028	297.576	0,09	EUR 1.071.000	Paprec 3,5% 1/7/2028	981.090	0,31
EUR 870.000	SBB Treasury 0,75% 14/12/2028	488.114	0,15	EUR 1.033.000	Picard Groupe 3,875% 1/7/2026	954.141	0,30
EUR 1.480.000	SBB Treasury 1,125% 26/11/2029	821.622	0,26	EUR 5.500.000	RCI Banque 2,625% 18/2/2030	5.176.875	1,61
		2.169.006	0,68	USD 1.000.000	Societe Generale 7,875% 18/12/2023*	919.298	0,29
France				USD 1.200.000	Societe Generale 7,875% 18/12/2023	1.103.158	0,34
EUR 1.900.000	Accor 4,375% 31/1/2024	1.879.717	0,59	EUR 600.000	Societe Generale 7,875% 18/1/2029	586.494	0,18
EUR 400.000	Air France-KLM 1,875% 16/1/2025	380.728	0,12	USD 652.000	Societe Generale 8% 29/9/2025	591.079	0,18
EUR 700.000	Air France-KLM 8,125% 31/5/2028	730.090	0,23	EUR 825.000	Tereos Finance Groupe I 7,25% 15/4/2028	856.474	0,27
EUR 1.400.000	Altice France 2,125% 15/2/2025	1.298.500	0,40	EUR 1.334.000	Vallourec 8,5% 30/6/2026	1.333.853	0,41
EUR 577.000	Altice France 2,5% 15/1/2025	535.098	0,17	45.063.272 14,05			
EUR 446.000	Altice France 3,375% 15/1/2028	312.702	0,10	Allemagne			
EUR 687.000	Altice France 5,875% 1/2/2027	556.855	0,17	EUR 3.100.000	Bayer 4,5% 25/3/2082*	2.948.064	0,92
EUR 1.700.000	Atos 0% 6/11/2024	1.433.397	0,45	EUR 1.231.000	Cheplapharm Arzneimittel 4,375% 15/1/2028	1.124.722	0,35
EUR 700.000	Atos 1,75% 7/5/2025*	576.975	0,18	EUR 2.800.000	Commerzbank 6,125% 9/10/2025	2.543.100	0,79
EUR 600.000	Atos 2,5% 7/11/2028	427.503	0,13	EUR 500.000	Commerzbank 6,75% 5/10/2033	497.998	0,16
EUR 1.421.000	Banijay 6,5% 1/3/2026	1.406.833	0,44	GBP 200.000	Commerzbank 8,625% 28/2/2033	230.838	0,07
USD 260.000	BNP Paribas 5,285% 28/3/2024	222.629	0,07	EUR 1.200.000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1,875% 15/10/2024*	757.092	0,24
USD 600.000	BNP Paribas 6,625% 25/3/2024	547.704	0,17	EUR 400.000	Deutsche Bank 10% 1/12/2027	400.808	0,12
EUR 800.000	BNP Paribas 7,375% 11/6/2030	790.000	0,25	EUR 300.000	Deutsche Lufthansa 2,875% 16/5/2027	276.622	0,08
EUR 449.000	Burger King France 8,475% 1/11/2026*	451.514	0,14	EUR 800.000	Deutsche Lufthansa 3,5% 14/7/2029	727.484	0,23
GBP 1.600.000	Clariane 4,125% 15/3/2024	1.446.105	0,45	EUR 1.600.000	DIC Asset 2,25% 22/9/2026	878.000	0,27
EUR 935.000	Crown European 3,375% 15/5/2025	918.329	0,29	EUR 1.762.000	Gruenthal 4,125% 15/5/2028	1.649.029	0,51
				EUR 664.000	Gruenthal 6,75% 15/5/2030	683.588	0,21
				EUR 1.206.000	HT Troplast 9,375% 15/7/2028	1.210.354	0,38

~ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

European High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 225.909	IHO Verwaltungs 3,75% 15/9/2026	215.097	0,07				
EUR 352.000	IHO Verwaltungs 3,875% 15/5/2027	320.000	0,10				
EUR 1.414.000	IHO Verwaltungs 8,75% 15/5/2028	1.476.980	0,46				
EUR 856.000	PCF 4,75% 15/4/2026*	667.530	0,21				
EUR 1.991.000	Renk/Frankfurt am Main 5,75% 15/7/2025	1.976.127	0,61				
EUR 1.494.637	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	1.470.154	0,46				
EUR 1.620.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	1.562.474	0,49				
EUR 2.525.000	Tele Columbus 3,875% 2/5/2025*	1.620.166	0,51				
EUR 1.500.000	TK Elevator Midco 4,375% 15/7/2027	1.369.710	0,43				
EUR 796.000	TUI Cruises 6,5% 15/5/2026	755.500	0,23				
EUR 600.000	ZF Finance 2% 6/5/2027	533.700	0,17				
EUR 600.000	ZF Finance 2,25% 3/5/2028*	514.290	0,16				
EUR 700.000	ZF Finance 2,75% 25/5/2027	636.835	0,20				
EUR 200.000	ZF Finance 3,75% 21/9/2028	181.891	0,06				
EUR 900.000	ZF Finance 5,75% 3/8/2026	906.291	0,28				
		28.134.444	8,77				
	Irlande						
EUR 2.728.000	AIB 5,25% 9/10/2024	2.565.684	0,80				
EUR 634.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2,125% 15/8/2026	566.146	0,18				
EUR 700.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2,125% 15/8/2026	624.764	0,20				
GBP 1.642.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4,75% 15/7/2027	1.514.848	0,47				
EUR 200.000	Avoca CLO XV 7,793% 15/4/2031	177.749	0,06				
EUR 1.480.000	Bank of Ireland 7,5% 19/5/2025	1.453.405	0,45				
EUR 1.000.000	BBAM European CLO II 9,773% 15/10/2034	932.613	0,29				
EUR 800.000	BlueMountain Fuji Eur CLO IV 10,036% 25/2/2034	747.914	0,23				
EUR 728.000	Capital Four CLO III 9,723% 15/10/2034	673.420	0,21				
EUR 600.000	CIFC European Funding CLO III 9,273% 15/1/2034	555.952	0,17				
EUR 800.000	Contego CLO VIII 9,781% 25/1/2034	741.031	0,23				
EUR 1.400.000	CVC Cordatus Loan Fund XXVII 10,359% 15/4/2035	1.429.509	0,45				
EUR 629.087	Fair Oaks Loan Funding III 9,773% 15/10/2034	578.732	0,18				
EUR 131.366	Invesco Euro CLO III 11,733% 15/7/2032	118.331	0,04				
EUR 699.000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 2 9,723% 15/4/2034	648.633	0,20				
EUR 148.000	OCP Euro CLO 2017-2 8,663% 15/1/2032	142.855	0,04				
EUR 690.000	Palmer Square European CLO 2023-1 10,05% 15/7/2036	702.018	0,22				
EUR 750.000	Rockfield Park CLO 6,663% 16/7/2034	706.084	0,22				
GBP 1.473.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4,875% 15/7/2028	1.415.239	0,44				
		16.294.927	5,08				
					Italie		
EUR 2.838.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	2.765.617	0,86				
EUR 1.221.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6,75% 2/3/2026	1.226.824	0,38				
EUR 1.347.000	Banco BPM 2,875% 29/6/2031	1.205.565	0,38				
EUR 800.000	Banco BPM 3,25% 14/1/2031	744.000	0,23				
EUR 1.283.000	Banco BPM 3,375% 19/1/2032*	1.140.266	0,36				
EUR 222.000	Banco BPM 4,25% 1/10/2029	218.948	0,07				
EUR 1.575.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	1.585.261	0,49				
EUR 610.000	Castor 8,776% 15/2/2029	576.956	0,18				
EUR 728.000	Cedacri Mergeco 8,424% 15/5/2028	711.849	0,22				
EUR 737.000	Cedacri Mergeco 9,281% 15/5/2028	725.993	0,23				
EUR 717.000	Enel 6,375% 16/4/2028	732.953	0,23				
EUR 1.099.000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11,125% 15/5/2028	1.098.703	0,34				
EUR 1.489.000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027*	1.606.311	0,50				
EUR 1.420.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5,625% 1/8/2027	1.329.951	0,41				
EUR 577.000	IMA Industria Macchine Automatiche 3,75% 15/1/2028	516.574	0,16				
EUR 583.000	IMA Industria Macchine Automatiche 7,663% 15/1/2028*	581.679	0,18				
EUR 2.056.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,625% 21/10/2028	1.813.310	0,57				
EUR 1.610.000	Inter Media and Communication 6,75% 9/2/2027	1.557.361	0,48				
GBP 303.000	Intesa Sanpaolo 5,148% 10/6/2030	297.222	0,09				
EUR 3.450.000	Intesa Sanpaolo 5,5% 1/3/2028*	2.997.187	0,94				
EUR 500.000	Intesa Sanpaolo 5,875% 20/1/2025*	483.125	0,15				
EUR 466.000	Lottomatica 7,6% 1/6/2028	469.977	0,15				
EUR 1.952.000	Lottomatica 9,75% 30/9/2027	2.118.603	0,66				
EUR 114.000	Mundys 1,625% 3/2/2025	109.454	0,03				
EUR 1.000.000	Mundys 1,875% 12/2/2028*	864.690	0,27				
EUR 3.200.000	Nexi 0% 24/2/2028	2.503.631	0,78				
EUR 1.428.000	Poste Italiane 2,625% 24/3/2029	1.117.410	0,35				
EUR 2.300.000	Rekeep 7,25% 1/2/2026*	2.140.645	0,67				
EUR 2.745.000	Telecom Italia 1,625% 18/1/2029	2.163.527	0,67				
EUR 500.000	Telecom Italia 2,375% 12/10/2027	436.235	0,14				
EUR 563.000	Telecom Italia 2,75% 15/4/2025	541.958	0,17				
EUR 100.000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	96.673	0,03				
EUR 197.000	Telecom Italia 3,625% 25/5/2026	191.443	0,06				
EUR 100.000	Telecom Italia 5,25% 17/3/2055	80.232	0,03				
USD 983.000	Telecom Italia 5,303% 30/5/2024	895.261	0,28				
EUR 1.867.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	1.887.976	0,59				
EUR 1.233.000	Telecom Italia 7,875% 31/7/2028	1.283.430	0,40				
EUR 802.000	UniCredit 2% 23/9/2029	769.920	0,24				
EUR 655.000	UniCredit 2,731% 15/1/2032	587.044	0,18				
EUR 600.000	UniCredit 7,5% 3/6/2026*	601.500	0,19				
		42.775.264	13,34				
					Japon		
EUR 2.892.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	2.797.359	0,87				
EUR 235.000	SoftBank 3,125% 19/9/2025	223.396	0,07				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

European High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 1.294.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032	1.013.780	0,32	USD 192.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	146.996	0,05
EUR 520.000	SoftBank 4% 19/9/2029	447.881	0,14	USD 400.000	Telecom Italia Capital 6,375% 15/11/2033	322.567	0,10
EUR 364.000	SoftBank 4,5% 20/4/2025	357.443	0,11			24.119.297	7,52
EUR 1.305.000	SoftBank 4,75% 30/7/2025*	1.280.198	0,40				
EUR 320.000	SoftBank 5% 15/4/2028*	302.045	0,09				
		6.422.102	2,00				
	Jersey				Îles Marshall		
EUR 230.158	Adient Global 3,5% 15/8/2024	226.618	0,07	USD 1.700.000	Danaos 8,5% 1/3/2028	1.587.092	0,50
GBP 259.000	CPUK Finance 3,588% 28/8/2025	283.997	0,09		Pays-Bas		
GBP 147.000	CPUK Finance 4,5% 28/8/2027	150.089	0,05	EUR 2.400.000	Abertis Infraestructuras Finance 3,248% 24/11/2025	2.179.320	0,68
GBP 600.000	CPUK Finance 4,875% 28/8/2025	670.587	0,21	EUR 220.000	Axalta Coating Systems Dutch B 3,75% 15/1/2025	217.904	0,07
GBP 1.780.000	Galaxy Bidco 6,5% 31/7/2026	1.915.660	0,60	EUR 1.027.000	Energizer Gamma Acquisition 3,5% 30/6/2029	842.109	0,26
		3.246.951	1,02	EUR 908.000	Global Switch Finance 1,375% 7/10/2030	749.601	0,23
	Luxembourg			EUR 199.000	Heimstaden Bostad Treasury 0,625% 24/7/2025	171.582	0,05
EUR 400.000	ADLER 2% 23/11/2023	380.496	0,12	EUR 432.000	Heimstaden Bostad Treasury 1% 13/4/2028	311.158	0,10
EUR 1.538.000	Adler Financing 12,5% 30/6/2025	1.588.246	0,50	EUR 199.000	Heimstaden Bostad Treasury 1,375% 3/3/2027	157.801	0,05
EUR 1.100.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3,625% 1/6/2028*	903.320	0,28	USD 829.000	ING Groep 5,75% 16/11/2026	680.143	0,21
GBP 100.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,875% 1/6/2028	92.928	0,03	EUR 1.300.000	Naturgy Finance 2,374% 23/11/2026	1.155.050	0,36
EUR 1.194.000	Altice Financing 2,25% 15/1/2025	1.143.255	0,36	EUR 400.000	Naturgy Finance 3,375% 24/4/2024*	393.000	0,12
EUR 733.000	Altice Financing 4,25% 15/8/2029*	560.591	0,17	EUR 1.084.000	Nobian Finance 3,625% 15/7/2026*	965.486	0,30
EUR 2.500.000	Aroundtown 3,375% 23/9/2024	1.047.625	0,33	EUR 1.070.000	OI European 6,25% 15/5/2028	1.096.766	0,34
EUR 392.000	Cidron Aida Finco 5% 1/4/2028	359.893	0,11	EUR 996.000	Q-Park I 1,5% 1/3/2025*	963.839	0,30
GBP 795.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	820.845	0,26	EUR 414.000	Q-Park I 5,47% 1/3/2026*	406.358	0,13
EUR 869.000	Cirsa Finance International 4,75% 22/5/2025*	859.988	0,27	EUR 1.466.000	Repsol International Finance 4,247% 11/9/2028	1.334.426	0,42
EUR 342.000	Cirsa Finance International 7,875% 31/7/2028	344.329	0,11	EUR 1.858.143	Summer BidCo 9% 15/11/2025*	1.766.063	0,55
EUR 550.000	Cirsa Finance International 8,185% 31/7/2028	549.585	0,17	EUR 670.519	Summer BidCo 9% 15/11/2025	629.765	0,20
EUR 1.417.131	Codere Finance 2 Luxembourg 11% 30/9/2026	1.062.480	0,33	EUR 1.500.000	Telefonica Europe 3,875% 22/6/2026	1.402.800	0,44
EUR 1.320.000	Cullinan Holdco Scsp 4,625% 15/10/2026*	1.107.044	0,35	EUR 3.300.000	Telefonica Europe 6,135% 3/2/2030	3.229.677	1,01
EUR 346.000	Dana Financing Luxembourg 3% 15/7/2029	274.518	0,08	EUR 1.200.000	Telefonica Europe 7,125% 23/8/2028	1.235.280	0,38
EUR 1.165.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	1.194.801	0,37	EUR 292.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4,5% 1/3/2025	288.687	0,09
EUR 1.200.000	European TopSoho 4% 21/9/2021***	924.000	0,29	EUR 2.611.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,375% 15/9/2029	2.680.257	0,84
EUR 678.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	525.355	0,16	EUR 718.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,875% 15/9/2031	753.221	0,23
GBP 1.419.000	Garfunkelux Holdco 3 7,75% 1/11/2025*	1.266.010	0,39	EUR 1.199.000	Trivium Packaging Finance 7,531% 15/8/2026*	1.181.387	0,37
EUR 932.000	Herens Midco 5,25% 15/5/2029*	502.357	0,16	EUR 523.000	United 4% 15/11/2027*	451.597	0,14
EUR 1.262.000	Kleopatra Finco 4,25% 1/3/2026*	1.050.653	0,33	EUR 695.000	United 7,031% 15/2/2026	680.391	0,21
EUR 639.000	LHMC Finco 2 7,25% 2/10/2025	638.431	0,20	EUR 740.000	UPC 3,875% 15/6/2029	616.546	0,19
EUR 601.000	Monitchem HoldCo 3 8,75% 1/5/2028	595.877	0,18	EUR 1.200.000	VZ Secured Financing 3,5% 15/1/2032	946.944	0,30
EUR 1.714.000	Rossini 6,75% 30/10/2025	1.728.998	0,54	EUR 1.306.000	VZ Vendor Financing II 2,875% 15/1/2029	1.018.595	0,32
EUR 1.780.000	SES 2,875% 27/5/2026	1.552.427	0,48	EUR 1.700.000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026*	1.567.366	0,49
EUR 900.000	SES 5,625% 29/1/2024	900.630	0,28	EUR 300.000	ZF Europe Finance 2,5% 23/10/2027	265.812	0,08
EUR 475.000	Stena International 7,25% 15/2/2028	491.404	0,15	EUR 945.000	Ziggo 2,875% 15/1/2030	783.159	0,24
EUR 1.302.000	Summer BC Holdco B 5,75% 31/10/2026	1.183.648	0,37			31.122.090	9,70
					Panama		
				EUR 1.305.000	Carnival 7,625% 1/3/2026	1.302.188	0,41

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

European High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Portugal				EUR 1.000.000	Heimstaden Bostad 3,375% 15/1/2026	468.450	0,15
EUR 600.000	Banco Espirito Santo 4% 21/1/2019***	129.000	0,04	EUR 811.891	Intrum 3,125% 15/7/2024	773.594	0,24
EUR 200.000	Banco Espirito Santo 4,75% 15/1/2018***	43.000	0,01	EUR 1.294.000	Intrum 4,875% 15/8/2025	1.122.500	0,35
EUR 600.000	EDP - Energias de Portugal 1,7% 20/7/2080	554.550	0,18	EUR 175.000	Intrum 9,25% 15/3/2028*	146.715	0,05
EUR 1.300.000	EDP - Energias de Portugal 1,875% 2/8/2081	1.163.500	0,36	EUR 273.000	Verisure 3,875% 15/7/2026	257.813	0,08
EUR 300.000	EDP - Energias de Portugal 5,943% 23/4/2083	297.600	0,09	EUR 709.000	Verisure 7,125% 1/2/2028	719.649	0,22
		2.187.650	0,68	EUR 1.230.000	Verisure 9,25% 15/10/2027	1.313.376	0,41
						6.781.056	2,11
Roumanie				Suisse			
EUR 1.600.000	RCS & RDS 2,5% 5/2/2025	1.535.144	0,48	GBP 500.000	Credit Suisse 7,75% 10/3/2026	603.727	0,19
				USD 1.762.000	UBS 7% 19/2/2025*	1.585.360	0,49
				EUR 1.412.000	UBS 7,75% 1/3/2029	1.596.577	0,50
						3.785.664	1,18
Espagne				Royaume-Uni			
EUR 1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/3/2024	989.640	0,31	EUR 600.000	Agps Bondco 5% 14/1/2029	175.842	0,06
EUR 800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 15/1/2026	761.352	0,24	EUR 1.200.000	Agps Bondco 5,5% 13/11/2026	403.500	0,13
EUR 700.000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	652.558	0,20	EUR 500.000	Agps Bondco 6% 5/8/2025	194.475	0,06
EUR 1.400.000	Banco de Sabadell 2,5% 15/4/2031	1.251.397	0,39	EUR 1.492.000	Allwyn Entertainment Financing UK 7,25% 30/4/2030	1.524.239	0,47
EUR 800.000	Banco de Sabadell 5,25% 7/2/2029	795.260	0,25	GBP 338.000	Barclays 5,875% 15/9/2024	365.529	0,11
EUR 400.000	Banco de Sabadell 5,75% 15/3/2026*	348.714	0,11	GBP 600.000	Barclays 6,375% 15/12/2025	623.049	0,19
EUR 600.000	Banco de Sabadell 6% 16/8/2033	567.300	0,17	GBP 600.000	Barclays 7,125% 15/6/2025	647.365	0,20
EUR 800.000	Bankinter 7,375% 15/8/2028*	764.860	0,24	USD 232.000	Barclays 8% 15/6/2024	209.776	0,07
EUR 1.400.000	CaixaBank 6,375% 19/9/2023*	1.403.500	0,44	EUR 536.000	BCP V Modular Services Finance II 4,75% 30/11/2028	453.134	0,14
EUR 1.600.000	CaixaBank 6,75% 13/6/2024	1.577.336	0,49	GBP 3.681.000	Bellis Acquisition 3,25% 16/2/2026	3.697.682	1,15
EUR 1.400.000	Cellnex Finance 1,5% 8/6/2028	1.216.005	0,38	GBP 692.000	Bellis Acquisition 4,5% 16/2/2026	710.086	0,22
EUR 700.000	Cellnex Finance 2% 15/9/2032	553.767	0,17	EUR 337.000	British Telecommunications 1,874% 18/8/2080	308.288	0,10
EUR 1.300.000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	1.023.760	0,32	GBP 2.350.000	British Telecommunications 8,375% 20/12/2083	2.750.037	0,86
EUR 2.000.000	Cellnex Telecom 0,75% 20/11/2031	1.538.340	0,48	EUR 257.000	Carnival 1% 28/10/2029	172.508	0,05
EUR 400.000	Cellnex Telecom 1% 20/4/2027	355.918	0,11	EUR 177.721	Codere New Topco 7,5% 30/11/2027	8.444	0,00
EUR 1.300.000	Cellnex Telecom 1,75% 23/10/2030*	1.067.469	0,33	GBP 1.011.000	Constellation Automotive Financing 4,875% 15/7/2027*	947.264	0,29
EUR 1.100.000	Cellnex Telecom 1,875% 26/6/2029	942.172	0,30	GBP 864.000	Gatwick Airport Finance 4,375% 7/4/2026	926.199	0,29
EUR 300.000	Cellnex Telecom 2,125% 11/8/2030	291.705	0,09	GBP 450.000	Heathrow Finance 3,875% 1/3/2027*	453.806	0,14
EUR 855.000	Food Service Project 5,5% 21/1/2027	816.025	0,26	GBP 900.000	Heathrow Finance 4,75% 1/3/2024	1.033.284	0,32
EUR 189.000	Grifols 1,625% 15/2/2025	183.110	0,06	GBP 256.000	Heathrow Finance 5,75% 3/3/2025*	290.910	0,09
EUR 617.000	Grifols 3,2% 1/5/2025	596.324	0,18	EUR 914.000	INEOS Finance 6,625% 15/5/2028*	909.398	0,28
EUR 703.000	Grifols 3,875% 15/10/2028	611.775	0,19	EUR 2.090.000	INEOS Quattro Finance 2 2,5% 15/1/2026	1.906.027	0,60
EUR 826.000	Grupo Antolin-Irausa 3,5% 30/4/2028	612.086	0,19	GBP 1.020.000	Iron Mountain UK 3,875% 15/11/2025	1.123.432	0,35
EUR 700.000	International Consolidated Airlines 3,75% 25/3/2029*	612.469	0,19	EUR 698.000	Lloyds Banking 4,947% 27/6/2025	654.187	0,20
EUR 330.000	Kaixo Bondco Telecom 5,125% 30/9/2029	291.727	0,09	GBP 128.000	Marks & Spencer 3,75% 19/5/2026	138.594	0,04
EUR 2.795.000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	2.600.803	0,81	GBP 1.192.000	Mobico 4,25% 26/11/2025	1.215.647	0,38
		22.425.372	6,99	GBP 750.000	Nationwide Building Society 5,75% 20/6/2027	754.306	0,24
Suède				USD 1.074.000	Neptune Energy Bondco 6,625% 15/5/2025	985.853	0,31
EUR 1.059.000	Dometic 3% 8/5/2026*	997.662	0,31	GBP 460.000	Pinewood Finance 3,625% 15/11/2027*	467.220	0,15
EUR 468.000	Fastighets Balder 2,873% 2/6/2081	314.824	0,10	GBP 1.019.000	Premier Foods Finance 3,5% 15/10/2026*	1.077.225	0,34
EUR 200.000	Heimstaden Bostad 1,125% 21/1/2026	167.201	0,05	GBP 912.000	Santander UK 6,75% 24/6/2024	1.032.777	0,32
EUR 1.150.000	Heimstaden Bostad 2,625% 1/2/2027	499.272	0,15				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

European High Yield Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	1.467.360	EUR	1.531.624	BNY Mellon	15/9/2023	708
EUR	13.036	CHF	12.505	BNY Mellon	15/9/2023	(23)
Plus-value nette non réalisée						685
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	8.263	GBP	7.128	BNY Mellon	15/9/2023	(62)
GBP	654.219	EUR	758.970	BNY Mellon	15/9/2023	5.054
Plus-value nette non réalisée						4.992
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
EUR	4.493	SEK	53.247	BNY Mellon	15/9/2023	(6)
SEK	8.024.332	EUR	684.029	BNY Mellon	15/9/2023	(6.057)
Moins-value nette non réalisée						(6.063)
Catégorie d'Actions couverte en USD						
USD	3.338.375	EUR	3.042.667	BNY Mellon	15/9/2023	32.711
Plus-value nette non réalisée						32.711
Total des moins-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 63.167.255)						(313.837)

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR (411.167)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2026	(3.866)	11.555
CDS	EUR (180.404)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	4.817	(41.236)
CDS	EUR (507.082)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	13.540	(115.907)
CDS	EUR 321.000	Fund receives default protection on Picard; and pays Fixed 5%	BNP Paribas	20/6/2028	(7.417)	(1.798)
CDS	EUR (570.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2026	38.017	16.019
CDS	EUR (300.134)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	7.347	(68.603)
CDS	EUR (804.702)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	79.255	(33.850)
CDS	EUR (650.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2026	43.666	27.055
CDS	EUR (147.139)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Citibank	20/12/2027	5.032	(33.632)
CDS	EUR (185.185)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Citibank	20/12/2027	6.334	(42.329)
CDS	EUR (399.666)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(4.627)	11.232
CDS	EUR (780.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes Finance; and receives Fixed 1%	Credit Suisse	20/12/2026	36.904	(10.584)
CDS	EUR (408.130)	Fund provides default protection on Elevator Holdcogmbh; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2026	1.395	16.042
CDS	EUR 599.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	2.004	118.101
CDS	EUR 599.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	HSBC Bank	20/6/2028	458	118.101
CDS	EUR (480.000)	Fund provides default protection on K And S 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2026	20.185	57.945
CDS	EUR (1.000.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes Finance; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2026	60.514	(13.569)
CDS	EUR (183.333)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	15.932	(3.690)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

European High Yield Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR (366.667)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	31.864	(7.379)
CDS	EUR (394.771)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	8.677	(90.235)
CDS	EUR (1.452.724)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	108.142	161.225
CDS	EUR (483.298)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	52.433	(20.330)
CDS	EUR (646.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	18.660	(24.065)
CDS	EUR 374.085	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(2.040)	512
CDS	EUR 468.915	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(3.084)	641
CDS	EUR (223.265)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	4.907	(51.033)
CDS	EUR (479.000)	Fund provides default protection on K And S 500; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	26.426	73.510
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 13.350.391)					565.475	53.698

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

European Special Situations Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				95.624	ASML	58.703.574	4,74
				331.111	BE Semiconductor Industries*	35.561.321	2,87
				123.330	Ferrari*	36.456.348	2,94
				238.252	IMCD	30.484.343	2,46
				1.093.077	STMicroelectronics	48.024.338	3,87
ACTIONS ORDINAIRES						248.225.579	20,03
Belgique				Espagne			
273.880	KBC	16.635.471	1,34	4.880.054	CaixaBank	18.456.364	1,49
Danemark				Suède			
241.393	DSV*	42.063.180	3,40	1.535.409	Atlas Copco	18.887.875	1,52
61.007	Genmab*	21.776.936	1,76	916.478	Epiroc	16.307.149	1,32
581.960	Novo Nordisk	99.791.027	8,05				
401.460	Royal Unibrew*	32.485.912	2,62				
		196.117.055	15,83			35.195.024	2,84
France				Suisse			
364.707	BNP Paribas	21.900.655	1,77	42.545	Belimo	20.574.686	1,66
522.149	Cie de Saint-Gobain	31.344.605	2,53	86.374	Lonza	44.312.226	3,58
15.656	Hermes International	30.018.815	2,42	21.308	Partners*	21.178.282	1,71
73.421	L'Oreal	30.131.978	2,43	131.307	Sika*	34.394.600	2,78
96.424	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	76.560.656	6,18	99.162	Straumann	13.918.621	1,12
78.992	Pernod Ricard	14.538.478	1,18			134.378.415	10,85
42.989	Sartorius Stedim Biotech	11.288.911	0,91	Royaume-Uni			
248.211	Schneider Electric	39.584.690	3,19	1.061.946	Allfunds	5.814.154	0,47
		255.368.788	20,61	461.380	Ashtead	29.983.429	2,42
Allemagne				1.656.894	Auto Trader	11.789.722	0,95
172.633	MTU Aero Engines	37.461.361	3,02	13.298.427	JD Sports Fashion*	22.739.690	1,84
19.482	Rational	13.725.069	1,11	1.394.256	RELX	42.062.038	3,40
		51.186.430	4,13	68.235	Spirax-Sarco Engineering	8.104.125	0,65
Irlande						120.493.158	9,73
7.596.067	AIB	31.949.058	2,58	Total des actions ordinaires			
330.593	Kingspan	25.720.135	2,07	1.188.830.967 95,95			
136.920	Linde	49.067.791	3,96	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
		106.736.984	8,61	1.188.830.967 95,95			
Italie				Total du portefeuille			
473.545	FinecoBank Banca Fineco	6.037.699	0,49	1.188.830.967 95,95			
Pays-Bas				Autres éléments de l'actif net			
8.395	Adyen	6.540.545	0,53	50.143.088 4,05			
72.267	ASM International	32.455.110	2,62	Total de l'actif net (EUR)			
				1.238.974.055 100,00			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

European Special Situations Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	2.037.848	EUR	1.209.650	BNY Mellon	15/9/2023	6.865
EUR	68.753	AUD	116.509	BNY Mellon	15/9/2023	(800)
Plus-value nette non réalisée						6.065
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	347.356	EUR	235.431	BNY Mellon	15/9/2023	1.139
EUR	13.535	CAD	19.945	BNY Mellon	15/9/2023	(50)
Plus-value nette non réalisée						1.089
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	376.214	EUR	47.440	BNY Mellon	15/9/2023	225
EUR	2.243	CNY	17.798	BNY Mellon	15/9/2023	(13)
Plus-value nette non réalisée						212
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	121.801	GBP	104.440	BNY Mellon	15/9/2023	(167)
GBP	1.831.052	EUR	2.123.727	BNY Mellon	15/9/2023	14.648
Plus-value nette non réalisée						14.481
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
EUR	123.225	HKD	1.049.523	BNY Mellon	15/9/2023	(116)
HKD	14.921.750	EUR	1.742.752	BNY Mellon	15/9/2023	10.858
Plus-value nette non réalisée						10.742
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	10.357.927	USD	11.288.652	BNY Mellon	15/9/2023	(41.370)
USD	195.736.867	EUR	178.489.292	BNY Mellon	15/9/2023	1.827.376
Plus-value nette non réalisée						1.786.006
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 196.549.127)						1.818.595

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	28,47
Valeurs industrielles	22,14
Biens de consommation cyclique	16,95
Technologie	14,10
Finance	9,38
Matériaux de base	3,96
Communications	0,95
Autres éléments de l'actif net	4,05
	100,00

European Sustainable Equity Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	36,03
Valeurs industrielles	31,58
Technologie	16,12
Finance	6,55
Matériaux de base	6,14
Services aux collectivités	1,12
Énergie	0,72
Autres éléments de l'actif net	1,74
	100,00

European Value Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	1.466.958	EUR	870.235	BNY Mellon	15/9/2023	5.480
EUR	186.406	AUD	316.459	BNY Mellon	15/9/2023	(2.507)
Plus-value nette non réalisée						2.973
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	59.499	EUR	7.516	BNY Mellon	15/9/2023	22
EUR	224	CNY	1.780	BNY Mellon	15/9/2023	(1)
Plus-value nette non réalisée						21
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
EUR	34.439	HKD	293.848	BNY Mellon	15/9/2023	(94)
HKD	9.910.078	EUR	1.157.443	BNY Mellon	15/9/2023	7.193
Plus-value nette non réalisée						7.099
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	1.650.124	USD	1.800.940	BNY Mellon	15/9/2023	(8.935)
USD	47.270.238	EUR	43.094.076	BNY Mellon	15/9/2023	452.207
Plus-value nette non réalisée						443.272
Total des plus-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 47.502.763)						453.365

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Valeurs industrielles	23,45
Finance	22,13
Biens de consommation non cyclique	21,58
Biens de consommation cyclique	9,75
Énergie	7,22
Services aux collectivités	5,19
Technologie	4,97
Matériaux de base	2,46
Autres éléments de l'actif net	3,25
	100,00

FinTech Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				33.474	Block	1.941.492	0,76
				98.548	Bread Financial*	3.729.056	1,46
				45.073	Capital One Financial	4.654.689	1,82
				203.089	Fidelity National Information Services	11.435.942	4,48
ACTIONS ORDINAIRES				88.295	Fiserv	10.802.893	4,23
Canada				101.802	Global Payments	12.975.683	5,08
354.428	Nuvei	6.416.005	2,51	17.115	JPMorgan Chase	2.529.768	0,99
Îles Caïmans				199.050	Live Oak Bancshares*	6.514.907	2,55
939.606	Inter	4.087.286	1,60	6.569	Mastercard	2.722.719	1,07
1.890.707	Inter	8.319.853	3,26	245.557	NCR*	7.550.878	2,96
1.100.552	Pageseguro Digital*	10.015.023	3,92	553.733	Oportun Financial	3.887.206	1,52
363.549	XP*	9.341.392	3,66	787.111	Payoneer Global*	4.840.732	1,89
		31.763.554	12,44	525.000	Payoneer Global	3.228.750	1,27
France				110.643	PayPal	6.997.063	2,74
128.715	Worldline*	4.243.925	1,66	1.035.983	Repay	9.582.843	3,75
Italie				29.756	Shift4 Payments*	1.701.151	0,67
292.369	FinecoBank Banca Fineco	4.044.355	1,58	232.882	Synchrony Financial	7.570.994	2,97
715.046	Illimity Bank	4.740.051	1,86	10.558	Visa*	2.607.509	1,02
784.384	Nexi*	5.703.494	2,23	62.420	WEX	12.315.466	4,83
		14.487.900	5,67			148.340.024	58,11
Japon					Total des actions ordinaires	242.487.533	94,98
355.100	Rakuten Bank*	4.579.820	1,79		Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	242.487.533	94,98
Kazakhstan							
126.593	Kaspi.KZ JSC	13.165.672	5,16	Autres titres négociables			
Pays-Bas							
1.615	Adyen*	1.365.129	0,54	ACTIONS ORDINAIRES			
Corée du Sud							
88.102	KIWOOM	6.885.520	2,70	Chypre			
Suisse							
42.876	Temenos	3.427.326	1,34	269.863	TCS**	4.317.808	1,69
Royaume-Uni							
2.224.947	Cab Payments*	7.812.658	3,06	Royaume-Uni			
États-Unis							
30.602	American Express	4.903.358	1,92	1.692.947	Finablr**	21	0,00
145.956	AssetMark Financial	4.222.507	1,66		Total des actions ordinaires	4.317.829	1,69
125.972	Axos Financial	5.405.459	2,12		Total des autres valeurs mobilières	4.317.829	1,69
213.914	Black Knight	16.218.959	6,35		Total du portefeuille	246.805.362	96,67
					Autres éléments de l'actif net	8.507.734	3,33
					Total de l'actif net (USD)	255.313.096	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	42.160.463	USD	46.250.108	BNY Mellon	15/9/2023	(483.690)
USD	3.984.864	EUR	3.659.630	BNY Mellon	15/9/2023	12.245
Moins-value nette non réalisée						(471.445)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	6.876.569	USD	8.748.351	BNY Mellon	15/9/2023	(30.831)
USD	1.073.642	GBP	846.352	BNY Mellon	15/9/2023	710
Moins-value nette non réalisée						(30.121)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	222	SGD	300	BNY Mellon	5/9/2023	-
SGD	9.008.779	USD	6.691.856	BNY Mellon	15/9/2023	(23.806)
USD	616.849	SGD	835.036	BNY Mellon	15/9/2023	(1.220)
Moins-value nette non réalisée						(25.026)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 66.784.835)						(526.592)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Finance	44,22
Biens de consommation non cyclique	26,66
Technologie	24,52
Produits accessoires	1,27
Autres éléments de l'actif net	3,33
	100,00

Fixed Income Global Opportunities Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Irlande				Japon			
77.376	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻	3.444.006	0,05	493.120	Mitsubishi UFJ Financial*	3.925.594	0,06
				176.960	Mizuho Financial*	2.917.955	0,04
				83.760	Sumitomo Mitsui Financial	3.828.817	0,05
						10.672.366	0,15
				Luxembourg			
				185.521	ADLER	102.854	0,00
				33.760	HomeToGo (Wts 31/12/2025)	366	0,00
						103.220	0,00
Luxembourg				Pays-Bas			
122.600	BlackRock Strategic Funds - Emerging Markets Short Duration Bond Fund ⁻	14.724.260	0,20	1.101	ASML	733.319	0,01
				742	ASML*	493.689	0,01
Total des Compartiments				10.076	ING Groep*	144.673	0,00
		18.168.266	0,25	1.133	NXP Semiconductors	233.704	0,00
						1.605.385	0,02
ACTIONS ORDINAIRES ET WARRANTS							
Belgique				Panama			
29.959	Azelis	657.878	0,01	7.864	Carnival	124.330	0,00
Canada				Espagne			
90.595	Lions Gate Entertainment*	701.205	0,01	18.559	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	147.915	0,00
99.749	Northern Graphite	22.119	0,00	Suède			
		723.324	0,01	8.015	Swedbank	143.229	0,00
Îles Caïmans				Suisse			
97.700	Alibaba	1.123.622	0,01	3.674	ABB	140.186	0,00
32.600	Baidu	579.428	0,01	229	Swisscom*	139.857	0,00
25.300	JD.com	415.485	0,01	410.825	Transocean*	3.376.981	0,05
38.370	Lavoro (Wts 27/12/2027) ^o	29.929	0,00			3.657.024	0,05
44.600	Meituan	730.730	0,01	Taiwan			
26.500	NetEase	553.450	0,01	3.209	Taiwan Semiconductor Manufacturing	301.229	0,01
27.700	Tencent	1.147.842	0,02	Royaume-Uni			
54.500	Wuxi Biologics Cayman	306.793	0,01	197.415	Babcock International	960.471	0,01
211.800	Xiaomi	333.783	0,00	916.528	Barclays	1.726.722	0,03
		5.221.062	0,08	524.089	Mobico	562.714	0,01
Chine				2.236	Shell*	139.012	0,00
1.128.000	Bank of China	382.569	0,00	43.738	Shell*	1.360.013	0,02
44.000	BYD	1.378.966	0,02			4.748.932	0,07
988.000	China Construction Bank	529.085	0,01	États-Unis			
56.000	China Merchants Bank	221.345	0,00	12.858	Activision Blizzard	1.182.936	0,02
1.097.000	Industrial & Commercial Bank of China	503.533	0,01	269	Adobe	150.027	0,00
85.500	Ping An Insurance of China	511.824	0,01	8.548	Advanced Micro Devices	918.055	0,01
		3.527.322	0,05	14.015	Alphabet	1.931.687	0,03
Curaçao				1.113	Alphabet	152.192	0,00
16.979	Schlumberger	999.044	0,01	3.437	Applied Materials	522.252	0,01
France				303.507	Astra Space	80.278	0,00
3.902	Accor	140.636	0,00	12.672	Aurora Innovation (Wts 31/12/2028)	6.616	0,00
14.167	BNP Paribas	922.994	0,02	697	Autodesk	154.985	0,00
66	Hermes International	137.298	0,00	49	Booking	152.017	0,00
2.595	Unibail-Rodamco-Westfield	139.476	0,00	788	Broadcom	718.475	0,01
		1.340.404	0,02	9.936	Caesars Entertainment	543.797	0,01
Allemagne				41.620	California Resources*	2.314.904	0,03
14.295	Covestro	763.057	0,01	50.290	Cano Health (Wts 3/6/2026)	2.565	0,00
50.051	Fresenius	1.613.873	0,02	56.134	Cano Health (Wts 6/7/2025)	2.863	0,00
15.255	Mercedes-Benz	1.123.968	0,02	559	Caterpillar	158.052	0,00
864	Siemens	130.616	0,00	5.833	Chesapeake Energy*	514.179	0,01
		3.631.514	0,05	2.827	Cisco Systems	161.945	0,00
Guernesey				7.508	Constellation Brands	1.954.408	0,03
240.983	Genius Sports	1.607.357	0,02	342	Deere*	141.591	0,00
Irlande				51.159	Delta Air Lines	2.197.279	0,03
719	Eaton	166.240	0,01	1.168	Dexcom	120.316	0,00
Italie				151.511	DiamondRock Hospitality*	1.230.269	0,02
28.817	UniCredit	711.432	0,01	1.774	Edwards Lifesciences	137.609	0,00
				59.890	Element Solutions*	1.245.712	0,02

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

^o Wts est une abréviation pour warrants.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
2.710	Eli Lilly	1.487.790	0,02	USD 2.004.000	Argentine Republic Government International Bond 4,25% 9/1/2038	706.520	0,01
183	Equinix	144.420	0,00	USD 2.723.936	Generacion Mediterranea SA / Central Termica Roca 9,875% 1/12/2027	2.410.683	0,04
6.865	Equitrans Midstream	66.316	0,00	USD 814.000	YPF 6,95% 21/7/2027	688.396	0,01
60.140	EVgo (Wts 15/9/2025)	34.851	0,00	USD 1.665.150	YPF 7% 30/9/2033	1.285.979	0,02
2.361	First Solar	445.261	0,01	USD 1.337.000	YPF 7% 15/12/2047	919.836	0,01
89.996	Ford Motor	1.093.451	0,01	USD 263.000	YPF 8,5% 27/6/2029	223.730	0,00
22.932	Forestar	659.295	0,01			6.946.527	0,10
28.639	Freeport-McMoRan	1.154.152	0,02				
32.518	General Motors	1.090.654	0,01				
59.822	Green Plains*	1.864.652	0,03				
23.025	Halliburton	895.212	0,01				
4.655	HCA Healthcare	1.302.841	0,02				
30.237	Informatica	631.953	0,01				
454	Intuitive Surgical	145.353	0,00				
3.184	KLA	1.596.935	0,02				
7.289	Las Vegas Sands	403.446	0,01				
6.113	Lennar	726.897	0,01				
387	Lululemon Athletica	147.602	0,00				
13.880	M/I Homes	1.355.660	0,02				
10.314	Marathon Petroleum	1.461.081	0,02				
785	Marsh & McLennan	154.268	0,00				
8.328	Meritage Homes*	1.151.429	0,02				
2.812	Microchip Technology*	231.765	0,00				
17.310	Micron Technology	1.216.201	0,02				
440	Microsoft	144.786	0,00				
154	Morgan Stanley	13.144	0,00				
22.338	Mr Cooper	1.265.224	0,02				
5.051	NVIDIA	2.511.307	0,04				
92.223	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	1.844	0,00				
2.205	ONEOK	144.075	0,00				
71.219	Park Hotels & Resorts	920.862	0,01				
32.025	Pear Therapeutics (Wts 4/2/2026)	3	0,00				
14.785	Phillips 66	1.673.514	0,02				
15.563	Pivotal Investment III (Wts 31/12/2027)	17	0,00				
6.623	Rockwell Automation	2.067.701	0,03				
4.439	RXO*	82.077	0,00				
25.799	Sarcos Technology & Robotics	28.379	0,00				
375.884	Sarcos Technology & Robotics (Wts 15/6/2027)	9.435	0,00				
150.040	Service Properties Trust	1.255.835	0,02				
254	ServiceNow	150.541	0,00				
325.291	Sonder	162.645	0,00				
520	Stryker	150.303	0,00				
64.560	Sunstone Hotel Investors	582.977	0,01				
6.313	Tesla	1.623.893	0,02				
38.800	Uber Technologies	1.815.064	0,03				
29.195	United Airlines	1.456.831	0,02				
57.792	United States Steel*	1.783.461	0,02				
11.639	Valero Energy	1.506.087	0,02				
82.846	Xenia Hotels & Resorts	988.353	0,01				
6.000	Yum China	319.777	0,00				
		56.814.629	0,77				
	Total des actions ordinaires et warrants	96.903.836	1,34				
	OBLIGATIONS						
	Angola						
USD 846.000	Angolan Government International Bond 8,75% 14/4/2032*	696.973	0,01				
	Argentine						
USD 2.371.000	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2035	711.383	0,01				
	Australie						
EUR 1.500.000	BHP Billiton Finance 5,625% 22/10/2079	1.641.975	0,02				
USD 1.217.000	FMG Resources August 2006 4,375% 1/4/2031	1.019.697	0,02				
USD 3.310.000	FMG Resources August 2006 6,125% 15/4/2032*	3.082.089	0,04				
USD 187.500	Linc Energy 0% 10/4/2018***	1.078	0,00				
EUR 2.700.000	Origin Energy Finance 1% 17/9/2029	2.723.466	0,04				
EUR 720.000	Transurban Finance 4,225% 26/4/2033	774.025	0,01				
		9.242.330	0,13				
	Autriche						
EUR 2.000.000	ams-OSRAM 0% 5/3/2025	1.822.133	0,02				
EUR 2.400.000	ams-OSRAM 2,125% 3/11/2027	1.848.408	0,03				
EUR 746.000	ams-OSRAM 6% 31/7/2025	750.132	0,01				
EUR 1.200.000	Erste Bank 4,25% 30/5/2030	1.303.575	0,02				
USD 1.457.000	Klabn Austria 3,2% 12/1/2031	1.167.756	0,02				
EUR 3.300.000	Lenzing 5,75% 7/9/2025*	3.220.998	0,04				
USD 1.517.000	Suzano Austria 3,125% 15/1/2032	1.196.670	0,02				
USD 758.000	Suzano Austria 5% 15/1/2030	704.099	0,01				
		12.013.771	0,17				
	Bahamas						
USD 602.000	Intercorp Peru 3,875% 15/8/2029	510.984	0,01				
	Bahreïn						
USD 1.457.000	Bahrain Government International Bond 5,45% 16/9/2032*	1.311.060	0,02				
USD 989.000	Bahrain Government International Bond 7,5% 20/9/2047*	913.455	0,01				
		2.224.515	0,03				
	Belgique						
GBP 1.000.000	Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	1.229.711	0,02				
GBP 5.612.000	Anheuser-Busch InBev 9,75% 30/7/2024	7.354.863	0,10				
EUR 693.000	Azelis Finance 5,75% 15/3/2028*	766.457	0,01				
EUR 2.100.000	Elia 2,75% 2/10/2023	2.270.411	0,03				
GBP 1.000.000	KBC 1,25% 21/9/2027	1.091.859	0,01				
EUR 600.000	Solvay 2,5% 2/12/2025	604.983	0,01				
		13.318.284	0,18				
	Bénin						
EUR 473.000	Benin Government International Bond 4,875% 19/1/2032*	384.710	0,01				
EUR 473.000	Benin Government International Bond 6,875% 19/1/2052	354.722	0,00				
		739.432	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Bermudes				USD 250.000	First Quantum Minerals 6,875% 15/10/2027	243.578	0,00
USD 1.508.540	Digicel 8% 1/4/2025***	354.507	0,00	USD 1.150.000	First Quantum Minerals 7,5% 1/4/2025	1.149.293	0,02
USD 517.000	Inkia Energy 5,875% 9/11/2027	498.132	0,00	USD 200.000	First Quantum Minerals 8,625% 1/6/2031	203.756	0,00
USD 1.668.000	Luye Pharma 6,25% 6/7/2028	1.498.427	0,02	USD 343.000	Garda World Security 7,75% 15/2/2028	342.489	0,00
USD 25.710.000	PFP 2022-9 7,587% 19/8/2035	25.665.661	0,36	USD 2.099.000	Mattamy 4,625% 1/3/2030	1.853.354	0,03
USD 655.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4,85% 14/10/2038*	576.325	0,01	USD 1.748.000	Mattamy 5,25% 15/12/2027	1.645.544	0,02
		28.593.052	0,39	USD 991.000	NOVA Chemicals 4,875% 1/6/2024	974.728	0,01
Brésil				USD 3.000.000	Rogers Communications 2,95% 15/3/2025	2.863.614	0,04
USD 1.740.000	Banco do Brasil 6,25% 18/4/2030	1.728.081	0,02	USD 4.970.000	Rogers Communications 3,8% 15/3/2032	4.240.318	0,06
USD 1.236.000	Banco Votorantim 4,5% 24/9/2024	1.210.810	0,02	USD 325.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,8% 10/3/2027	297.758	0,00
BRL 27.171.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	5.474.235	0,08	GBP 1.000.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,875% 5/4/2027	1.138.076	0,02
BRL 86.435.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	17.665.267	0,24	EUR 1.900.000	TotalEnergies Capital Canada 2,125% 18/9/2029	1.889.982	0,03
USD 1.942.000	BRF 4,875% 24/1/2030	1.680.539	0,02			25.665.305	0,36
		27.758.932	0,38	Îles Caïmans			
Îles Vierges britanniques				USD 500.000	522 Funding CLO 2018-3A 7,638% 20/10/2031	489.799	0,01
USD 300.000	Champion Path 4,85% 27/1/2028	241.853	0,00	USD 2.153.121	ABRA Global Finance 11,5% 2/3/2028	1.817.041	0,03
USD 338.000	Fortune Star BVI 5% 18/5/2026	223.959	0,00	USD 2.609.706	ACAS CLO 2015-1 6,462% 18/10/2028	2.598.614	0,04
USD 400.000	Fortune Star BVI 5,95% 19/10/2025	314.320	0,01	USD 500.000	ACAS CLO 2015-1 7,172% 18/10/2028	492.007	0,01
EUR 852.000	Global Switch 2,25% 31/5/2027	860.472	0,01	USD 3.870.000	ACAS CLO 2015-1 7,772% 18/10/2028	3.804.807	0,05
HKD 8.000.000	Link CB 4,5% 12/12/2027	1.014.477	0,01	USD 250.000	AGL CLO 11 11,93% 15/4/2034	245.285	0,00
USD 282.000	New Metro Global 4,8% 15/12/2024	110.961	0,00	USD 375.000	AGL CLO 3 8,87% 15/1/2033	370.804	0,01
USD 242.000	RKPF Overseas 2019 A 6% 4/9/2025	112.530	0,00	USD 410.000	AGL CLO 5 6,988% 20/7/2034	398.501	0,01
USD 369.000	RKPF Overseas 2019 A 6,7% 30/9/2024*	246.593	0,00	USD 4.700.000	AGL CLO 5 7,288% 20/7/2034	4.645.165	0,06
USD 486.480	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033	474.508	0,00	USD 1.460.000	AGL CLO 7 8,67% 15/7/2034	1.424.932	0,02
USD 700.000	Studio City 7% 15/2/2027	664.548	0,01	USD 250.000	AGL CLO 9 9,288% 20/1/2034	247.706	0,00
USD 850.000	Studio City Finance 5% 15/1/2029*	639.502	0,01	USD 1.030.000	AGL CLO 9 12,848% 20/1/2034	1.039.158	0,01
		4.903.723	0,05	USD 400.000	Ahli United Sukuk 3,875% 17/6/2026	365.994	0,01
Canada				USD 250.000	AIMCO CLO Series 2015-A 7,17% 17/10/2034	247.686	0,00
USD 1.442.129	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust 5% 15/12/2023	1.436.911	0,02	USD 250.000	AIMCO CLO Series 2017-A 8,738% 20/4/2034	239.862	0,00
EUR 1.727.000	Alimentation Couche-Tard 1,875% 6/5/2026	1.771.236	0,02	USD 1.560.000	Allegro CLO II-S 7,745% 21/10/2028	1.556.885	0,02
USD 778.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	649.050	0,01	USD 2.270.000	Allegro CLO II-S 8,595% 21/10/2028	2.271.448	0,03
USD 1.159.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 6,25% 15/9/2027	1.072.545	0,02	USD 370.000	Allegro CLO IV 7,12% 15/1/2030	366.604	0,01
USD 1.500.000	Canadian Pacific Railway 1,35% 2/12/2024	1.421.984	0,02	USD 1.056.106	Allegro CLO VI 6,7% 17/1/2031	1.052.446	0,01
USD 1.500.000	Canadian Pacific Railway 4% 1/6/2028	1.432.858	0,02	USD 500.000	Allegro CLO XI 7,432% 19/1/2033	494.944	0,01
USD 1.055.000	First Quantum Minerals 6,875% 1/3/2026	1.038.231	0,02	USD 690.000	Allegro CLO XI 8,582% 19/1/2033	690.954	0,01
				USD 477.768	AMMC CLO 21 6,877% 2/11/2030	476.511	0,01
				USD 2.216.584	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 6,553% 13/4/2031	2.205.096	0,03
				USD 695.020	Anchorage Capital CLO 2013-1 6,813% 13/10/2030	693.105	0,01
				USD 1.070.000	Anchorage Capital CLO 2013-1 7,213% 13/10/2030	1.066.665	0,02
				USD 340.000	Anchorage Capital CLO 2013-1 7,713% 13/10/2030	336.440	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 417.000	Anchorage Capital CLO 2013-1 8,763% 13/10/2030	414.590	0,01	USD 350.000	Cayuga Park CLO 7,22% 17/7/2034	345.611	0,01
USD 680.206	Anchorage Capital CLO 3-R 6,677% 28/1/2031	677.430	0,01	USD 6.231.520	CBAM 2017-1 6,838% 20/7/2030	6.229.028	0,09
USD 1.650.000	Anchorage Capital CLO 3-R 7,127% 28/1/2031	1.638.293	0,02	USD 750.000	CBAM 2017-1 7,988% 20/7/2030	744.007	0,01
USD 1.178.929	Anchorage Capital CLO 4-R 6,677% 28/1/2031	1.170.920	0,02	USD 850.000	CIFC Funding 2013-III-R 7,457% 24/4/2031	833.632	0,01
USD 1.500.000	Anchorage Capital CLO 4-R 7,477% 28/1/2031	1.466.077	0,02	USD 246.496	CIFC Funding 2014 6,672% 18/1/2031	245.989	0,00
USD 697.947	Apidos CLO XII 6,65% 15/4/2031	694.203	0,01	USD 710.000	CIFC Funding 2014-III 6,807% 22/10/2031	708.757	0,01
USD 1.036.669	Apidos CLO XV 6,598% 20/4/2031	1.032.821	0,01	USD 250.000	CIFC Funding 2014-II-R 8,407% 24/4/2030	247.535	0,00
USD 250.000	Apidos CLO XXXI 7,12% 15/4/2031	247.955	0,00	USD 3.530.000	CIFC Funding 2017-I 7,295% 23/4/2029	3.519.797	0,05
USD 250.000	Apidos CLO XXXII 7,988% 20/1/2033	250.594	0,00	USD 2.730.000	CIFC Funding 2017-I 8,045% 23/4/2029	2.753.831	0,04
USD 300.000	Apidos CLO XXXII 9,088% 20/1/2033	296.409	0,00	USD 968.690	CIFC Funding 2017-II 6,538% 20/4/2030	965.072	0,01
USD 375.000	Apidos CLO XXXV 11,338% 20/4/2034	360.486	0,01	USD 250.000	CIFC Funding 2017-IV 7,157% 24/10/2030	248.201	0,00
USD 820.000	Apidos CLO XXXVII 11,907% 22/10/2034	816.026	0,01	USD 232.767	CIFC Funding 2017-V 6,75% 16/11/2030	232.535	0,00
USD 1.798.000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2022-FL2 7,16% 15/5/2037	1.785.411	0,02	USD 600.000	CIFC Funding 2017-V 8,42% 16/11/2030	587.953	0,01
USD 375.000	ARES XLV CLO 7,62% 15/10/2030	372.958	0,01	USD 5.640.000	CIFC Funding 2018-II 6,628% 20/4/2031	5.616.010	0,08
USD 1.417.894	Ares XXXVII CLO 6,74% 15/10/2030	1.416.651	0,02	USD 250.000	CIFC Funding 2018-II 7,188% 20/4/2031	248.063	0,00
USD 245.076	ASSURANT CLO 6,628% 20/4/2031	243.959	0,00	USD 250.000	CIFC Funding 2018-V 8,57% 15/1/2032	247.169	0,00
USD 1.790.000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 6,662% 19/7/2031	1.782.486	0,02	USD 480.000	CK Hutchison International 23 4,75% 21/4/2028	467.918	0,01
USD 2.740.000	Bain Capital Credit CLO 2021-3 8,707% 24/7/2034	2.617.913	0,04	USD 405.000	CK Hutchison International 23 4,875% 21/4/2033*	390.460	0,01
USD 430.000	Bain Capital Credit CLO 2021-4 6,758% 20/10/2034	426.668	0,01	USD 178.436	Clear Creek CLO 6,788% 20/10/2030	177.744	0,00
USD 250.000	Ballyrock CLO 14 7,888% 20/1/2034	247.246	0,00	USD 1.400.000	Clear Creek CLO 8,538% 20/10/2030	1.393.591	0,02
USD 1.410.000	Ballyrock CLO 2020-2 11,738% 20/10/2031	1.349.408	0,02	USD 3.268.454	Deer Creek CLO 2017-1 6,768% 20/10/2030	3.254.967	0,05
USD 1.060.000	Bardot CLO 8,607% 22/10/2032	1.038.249	0,01	USD 500.000	Deer Creek CLO 2017-1 7,238% 20/10/2030	495.690	0,01
USD 933.026	Barings CLO 2015-II 6,778% 20/10/2030	930.645	0,01	USD 500.000	Deer Creek CLO 2017-1 11,938% 20/10/2030	485.881	0,01
USD 295.106	Barings CLO 2018-III 6,538% 20/7/2029	294.120	0,00	USD 1.488.000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	1.481.948	0,02
USD 750.000	Benefit Street Partners CLO V-B 6,678% 20/4/2031	747.258	0,01	USD 10.274.446	Dryden 53 CLO 6,69% 15/1/2031	10.247.840	0,14
USD 1.892.390	Benefit Street Partners CLO VIII 6,688% 20/1/2031	1.887.427	0,03	USD 413.006	Dryden XXVI Senior Loan Fund 6,47% 15/4/2029	411.638	0,01
USD 2.181.328	BlueMountain CLO 2013-2 6,787% 22/10/2030	2.173.847	0,03	USD 5.774.491	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 6,833% 15/8/2030	5.760.387	0,08
USD 509.893	BlueMountain CLO 2015-3 6,588% 20/4/2031	508.198	0,01	USD 1.000.000	Eaton Vance CLO 2018-1 7,77% 15/10/2030	983.401	0,01
USD 250.000	Canyon CLO 2018-1 6,64% 15/7/2031	249.015	0,00	USD 925.000	Fantasia 6,95% 17/12/2021***	51.953	0,00
USD 370.000	Canyon CLO 2020-3 12,82% 15/1/2034	354.458	0,01	USD 1.781.000	Fantasia 7,95% 5/7/2022***	85.381	0,00
USD 460.766	Carbone CLO 6,728% 20/1/2031	460.191	0,01	USD 794.000	Fantasia 9,25% 28/7/2023***	39.700	0,00
USD 2.006.738	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 6,54% 17/4/2031	1.998.609	0,03	USD 2.580.000	Fantasia 11,75% 17/4/2022***	129.000	0,00
USD 4.237.874	CARLYLE US CLO 2017-4 6,75% 15/1/2030	4.228.446	0,06	USD 411.000	Fantasia 11,875% 1/6/2023***	20.550	0,00
USD 750.000	CarVal CLO I 8,46% 16/7/2031	731.178	0,01	USD 2.865.000	Gaci First Investment 4,75% 14/2/2030	2.785.138	0,04
				USD 3.258.000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	3.222.097	0,05
				USD 250.000	Galaxy XXII CLO 6,77% 16/4/2034	246.648	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 327.755		Galaxy XXIII CLO		USD 850.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 7,076%		
6,477%					20/1/2035	838.593	0,01
24/4/2029	326.149	0,00		USD 250.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 12,788%		
USD 245.556	Generate CLO 2 6,757%				20/1/2032	250.688	0,00
	22/1/2031	244.160	0,00	USD 250.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 46 7,238%		
USD 642.194	Generate CLO 2 6,838%				20/1/2036	247.512	0,00
	20/10/2029	639.301	0,01	USD 250.000	Ocean Trails CLO X 7,37%		
USD 5.995.000	Generate CLO 2 7,338%				15/10/2034	245.258	0,00
	20/10/2029	5.970.221	0,08	USD 457.099	OCP CLO 2014-5 6,692%		
USD 4.240.000	Generate CLO 2 9,188%				26/4/2031	456.177	0,01
	20/10/2029	4.221.337	0,06	USD 1.320.000	OCP CLO 2014-5 8,512%		
USD 1.520.000	Generate CLO 2 11,988%				26/4/2031	1.216.058	0,02
	20/10/2029	1.443.878	0,02	USD 1.170.000	OCP CLO 2014-7 5,106%		
USD 730.000	Generate CLO 2 12,838%				20/7/2029	1.065.230	0,01
	20/10/2029	680.477	0,01	USD 1.100.000	OCP CLO 2014-7 7,238%		
USD 2.090.000	Gilbert Park CLO 7,52%				20/7/2029	1.096.251	0,02
	15/10/2030	2.069.865	0,03	USD 360.000	OCP CLO 2017-14 7,591%		
USD 2.717.000	Gilbert Park CLO 8,52%				20/11/2030	353.342	0,01
	15/10/2030	2.617.565	0,04	USD 250.000	Octagon Investment Partners 18-R 6,53% 16/4/2031		
USD 500.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 6,608%				18/11/2031	248.835	0,00
	20/4/2034	496.407	0,01	USD 250.000	Octagon Loan Funding 7,341%		
USD 460.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 7,138%				18/11/2031	245.906	0,00
	20/10/2032	458.750	0,01	USD 1.422.582	OHA Loan Funding 2013-2 6,679% 23/5/2031		
USD 350.513	GoldenTree Loan Opportunities IX 6,741% 29/10/2029				22/10/2030	1.413.695	0,02
		348.122	0,01	USD 290.000	OZLM Funding IV 7,307%		
USD 1.166.000	Goldentree Loan Opportunities X 6,708% 20/7/2031				22/10/2030	287.315	0,00
		1.163.717	0,02	USD 3.200.000	OZLM VI 0% 17/4/2031		
USD 1.166.038	Goldentree Loan Opportunities XI 6,642% 18/1/2031				17/7/2029	199.565	0,00
		1.163.573	0,02	USD 500.000	OZLM VII 7,17% 17/7/2029		
USD 2.610.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 10,938% 20/10/2034				17/10/2029	493.915	0,01
		2.457.372	0,03	USD 815.000	OZLM VIII 8,72% 17/10/2029		
USD 2.650.000	Golub Capital Partners CLO 55B 12,148% 20/7/2034				20/4/2031	814.950	0,01
		2.664.324	0,04	USD 250.000	OZLM XX 7,238% 20/4/2031		
USD 224.682	Grippen Park CLO 6,848%				17/1/2031	244.943	0,00
	20/1/2030	224.472	0,00	USD 461.281	Palmer Square CLO 2014-1 6,7% 17/1/2031		
USD 320.000	Highbridge Loan Management 12-2018 6,822% 18/7/2031				17/1/2031	460.716	0,01
		315.341	0,00	USD 1.738.464	Palmer Square CLO 2018-1 6,602% 18/4/2031		
USD 2.552.901	HPS Loan Management 6-2015 6,631% 5/2/2031				16/7/2031	1.731.946	0,02
		2.535.208	0,04	USD 500.000	Palmer Square CLO 2018-2 7,22% 16/7/2031		
USD 1.668.000	IHS 5,625% 29/11/2026				15/11/2031	497.328	0,01
		1.440.385	0,02	USD 460.000	Palmer Square CLO 2020-3 7,226% 15/11/2031		
USD 916.000	IHS 6,25% 29/11/2028				20/7/2027	456.280	0,01
		737.192	0,01	USD 145.468	Parallel 2015-1 7,338%		
USD 3.000.000	iQIYI 6,5% 15/3/2028				20/7/2027	145.608	0,00
		2.647.500	0,04	USD 1.049.714	Pearl II 6% 2/10/2023		
USD 750.000	LCM XIV 6,628% 20/7/2031				22/10/2025	28.877	0,00
		742.998	0,01	USD 836.000	Pearl III 9% 22/10/2025		
USD 759.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10,875% 15/1/2031				24/7/2031	260.201	0,00
		763.592	0,01	USD 500.000	Pikes Peak CLO 1 6,787%		
USD 2.529.257	Loanpal Solar Loan 2021-1 2,29% 20/1/2048				15/7/2034	496.842	0,01
		1.871.229	0,03	USD 375.000	Pikes Peak CLO 4 8,82%		
USD 600.000	Madison Park Funding XIII 7,482% 19/4/2030				18/5/2034	370.021	0,01
		596.718	0,01	USD 500.000	Pikes Peak CLO 6 12,071%		
USD 397.464	Madison Park Funding XLI 6,437% 22/4/2027				24/8/2049	495.086	0,01
		396.159	0,01	USD 978.356	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV 4%		
USD 1.385.000	Madison Park Funding XLI 7,257% 22/4/2027				24/8/2049	953.534	0,01
		1.378.825	0,02	USD 9.164.792	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4%		
USD 700.000	Madison Park Funding XXX 10,52% 15/4/2029				24/8/2040	8.213.545	0,11
		663.266	0,01	USD 1.000.000	Regatta IX Funding 7,37%		
USD 991.000	MAF Global 6,375% 20/3/2026*				17/4/2030	998.965	0,01
		964.555	0,01	USD 2.180.000	Regatta IX Funding 8,02%		
USD 250.000	Marble Point CLO XVII 9,338% 20/4/2033				17/4/2030	2.193.154	0,03
		238.375	0,00	USD 500.000	Regatta IX Funding 9,47%		
USD 256.000	Melco Resorts Finance 5,375% 4/12/2029				17/4/2030	497.128	0,01
		214.403	0,00	USD 1.230.000	Regatta VIII Funding 7,27%		
USD 200.000	Melco Resorts Finance 5,625% 17/7/2027*				17/10/2030	1.230.118	0,02
		180.417	0,00	USD 910.000	Regatta VIII Funding 8,77%		
USD 448.000	MGM China 4,75% 1/2/2027*				17/10/2030	900.396	0,01
		405.032	0,00	USD 250.000	Regatta XVI Funding 7,62% 15/1/2033		
						249.376	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 500.000	Regatta XVI Funding 9,47% 15/1/2033	499.000	0,01	USD 200.000	Wynn Macau 5,5% 1/10/2027	179.360	0,00
USD 10.235.903	Rockford Tower CLO 2017-3 6,778% 20/10/2030	10.223.108	0,14	USD 1.296.000	Wynn Macau 5,625% 26/8/2028	1.138.478	0,02
USD 1.250.000	Rockford Tower CLO 2018-1 7,361% 20/5/2031	1.234.407	0,02			242.463.160	3,36
USD 341.000	Rockford Tower CLO 2018-2 6,748% 20/10/2031	339.892	0,00	Chili			
USD 1.500.000	RR 19 12,07% 15/10/2035	1.507.253	0,02	USD 2.341.000	Chile Government International Bond 4,34% 7/3/2042	2.013.330	0,03
USD 224.946	RR 3 6,66% 15/1/2030	224.558	0,00	USD 1.711.000	Empresa Nacional del Petroleo 3,75% 5/8/2026	1.609.598	0,02
USD 2.000.000	RR 4 7,12% 15/4/2030	1.990.078	0,03	USD 840.000	Empresa Nacional del Petroleo 6,15% 10/5/2033	831.457	0,01
USD 467.000	Sands China 4,3% 8/1/2026	437.486	0,01	USD 1.446.000	Engie Energia Chile 3,4% 28/1/2030	1.211.994	0,02
USD 519.000	Sands China 4,875% 18/6/2030	453.570	0,01			5.666.379	0,08
USD 1.003.000	Sands China 5,65% 8/8/2028	944.600	0,01	Chine			
USD 1.024.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	1.075.966	0,02	CNY 48.000.000	China Development Bank 3,3% 1/2/2024	6.619.531	0,09
USD 1.006.000	Seagate HDD Cayman 8,5% 15/7/2031	1.054.596	0,01	Colombie			
USD 2.485.000	Seagate HDD Cayman 9,625% 1/12/2032	2.755.082	0,04	USD 4.713.000	Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031	3.634.901	0,05
USD 300.000	Seazen 6% 12/8/2024*	159.000	0,00	EUR 566.000	Colombia Government International Bond 3,875% 22/3/2026	591.515	0,01
USD 2.365.069	Shackleton 2013-III CLO 6,69% 15/7/2030	2.344.881	0,03	USD 1.869.000	Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	1.724.825	0,02
USD 220.000	Shelf Drilling 8,875% 15/11/2024	220.825	0,00	USD 2.031.000	Colombia Government International Bond 4,125% 15/5/2051	1.220.631	0,02
USD 2.184.000	Shelf Drilling North Sea 10,25% 31/10/2025	2.192.996	0,03	USD 3.126.000	Colombia Government International Bond 4,5% 28/1/2026	3.016.871	0,04
USD 1.938.938	Silver Creek CLO 6,828% 20/7/2030	1.937.080	0,03	USD 3.349.000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033	3.462.063	0,05
USD 750.000	Silver Creek CLO 8,938% 20/7/2030	747.179	0,01	COP 32.940.600.000	Colombian TES 5,75% 3/11/2027	6.905.542	0,10
USD 309.430	Steele Creek CLO 2017-1 6,82% 15/10/2030	307.837	0,00	COP 29.709.900.000	Colombian TES 6,25% 26/11/2025	6.769.683	0,09
USD 2.213.000	Strata CLO I 0% 15/1/2118	1.034.299	0,01	COP 39.895.000.000	Colombian TES 7,5% 26/8/2026	9.154.335	0,13
USD 410.000	Strata CLO I 12,65% 15/1/2031	387.366	0,01	USD 2.666.000	Ecopetrol 4,125% 16/1/2025	2.583.221	0,04
USD 490.000	Symphony CLO XXIII 7,57% 15/1/2034	485.012	0,01	USD 1.440.000	Ecopetrol 5,875% 28/5/2045	1.007.129	0,01
USD 490.000	Symphony CLO XXIII 11,72% 15/1/2034	477.102	0,01	USD 5.301.000	Ecopetrol 6,875% 29/4/2030	4.931.255	0,07
USD 237.976	Tiaa CLO III 6,72% 16/1/2031	237.490	0,00	USD 3.648.000	Ecopetrol 8,875% 13/1/2033*	3.693.600	0,05
USD 750.000	Tiaa CLO III 7,07% 16/1/2031	739.810	0,01	USD 1.024.000	Oleoducto Central 4% 14/7/2027*	917.104	0,01
USD 2.486.619	TICP CLO IX 6,728% 20/1/2031	2.480.484	0,03	USD 1.343.000	Promigas / Gases del Pacifico 3,75% 16/10/2029	1.132.821	0,01
USD 500.000	TICP CLO XI 6,768% 20/10/2031	499.244	0,01	USD 1.930.000	SURA Asset Management 4,875% 17/4/2024	1.908.780	0,03
GBP 800.000	Trafford Centre Finance 6,128% 28/7/2035	725.096	0,01			52.654.276	0,73
USD 611.800	Transocean 8,75% 15/2/2030	628.715	0,01	Costa Rica			
USD 609.000	Transocean Titan Financing 8,375% 1/2/2028	626.510	0,01	USD 2.140.000	Costa Rica Government International Bond 6,125% 19/2/2031	2.139.272	0,03
USD 351.000	TRESTLES CLO II 7,283% 25/7/2031	349.399	0,01	USD 1.069.000	Costa Rica Government International Bond 6,55% 3/4/2034	1.078.573	0,01
USD 11.930.000	Triaxx Prime CDO 2006-1 5,949% 3/3/2039	14.799	0,00			3.217.845	0,04
USD 950.000	TRINITAS CLO IV 6,972% 18/10/2031	932.489	0,01	Côte d'Ivoire			
USD 590.000	Trinitas CLO XIV 7,613% 25/1/2034	583.220	0,01	EUR 346.000	Ivory Coast Government International Bond 4,875% 30/1/2032*	290.404	0,00
USD 625.000	Trinitas CLO XIV 8,613% 25/1/2034	623.716	0,01	EUR 687.000	Ivory Coast Government International Bond 5,875% 17/10/2031*	624.923	0,01
USD 1.769.440	Voya CLO 2013-2 6,583% 25/4/2031	1.757.945	0,02				
USD 1.040.000	Voya CLO 2016-1 8,238% 20/1/2031	911.010	0,01				
USD 2.925.567	Voya CLO 2017-4 6,7% 15/10/2030	2.915.728	0,04				
USD 234.000	Wynn Macau 5,125% 15/12/2029	191.720	0,00				
USD 280.000	Wynn Macau 5,5% 15/1/2026	262.809	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.984.000	Ivory Coast Government International Bond 6,125% 15/6/2033*	2.558.825	0,04	USD 632.000	Egypt Government International Bond 8,5% 31/1/2047	336.885	0,00
USD 4.291.000	Ivory Coast Government International Bond 6,375% 3/3/2028	4.066.967	0,06	USD 986.000	Egypt Government International Bond 8,5% 31/1/2047	525.582	0,01
EUR 383.000	Ivory Coast Government International Bond 6,625% 22/3/2048	291.352	0,00			6.608.149	0,09
EUR 345.000	Ivory Coast Government International Bond 6,875% 17/10/2040*	282.509	0,00	USD 1.270.000	El Salvador El Salvador Government International Bond 7,65% 15/6/2035	901.090	0,01
		8.114.980	0,11				
	Chypre				Finlande		
EUR 725.000	Bank of Cyprus 2,5% 24/6/2027	701.791	0,01	EUR 1.859.000	Ahlstrom 3 Oy 3,625% 4/2/2028	1.690.879	0,02
	République tchèque			USD 600.000	Ahlstrom 3 Oy 4,875% 4/2/2028	500.548	0,01
CZK 155.210.000	Czech Republic Government Bond 2,75% 23/7/2029	6.406.032	0,09	EUR 1.525.000	Finnair 4,25% 19/5/2025	1.570.764	0,02
CZK 34.780.000	Czech Republic Government Bond 4,2% 4/12/2036	1.537.977	0,02	EUR 200.000	SBB Treasury 0,75% 14/12/2028*	121.742	0,00
CZK 238.490.000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	11.176.417	0,16	EUR 700.000	SBB Treasury 1,125% 26/11/2029	421.615	0,01
		19.120.426	0,27			4.305.548	0,06
	Danemark				France		
GBP 1.600.000	Danske Bank 2,25% 14/1/2028	1.750.034	0,02	EUR 700.000	Accor 4,375% 31/1/2024	751.354	0,01
	République dominicaine			EUR 23.845	Air France-KLM 0,125% 25/3/2026	453.665	0,01
USD 1.116.000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6,75% 30/3/2029	1.091.548	0,02	EUR 1.700.000	Air France-KLM 7,25% 31/5/2026*	1.893.007	0,03
USD 2.821.000	Dominican Republic International Bond 4,5% 30/1/2030	2.466.852	0,04	EUR 400.000	Air France-KLM 8,125% 31/5/2028	452.633	0,01
USD 4.473.000	Dominican Republic International Bond 4,875% 23/9/2032	3.794.625	0,05	EUR 970.000	Altice France 2,125% 15/2/2025	976.098	0,01
USD 4.073.000	Dominican Republic International Bond 4,875% 23/9/2032	3.455.289	0,05	EUR 2.187.000	Altice France 2,5% 15/1/2025	2.200.464	0,03
USD 298.000	Dominican Republic International Bond 5,3% 21/1/2041	233.905	0,00	EUR 585.000	Altice France 4,25% 15/10/2029	441.407	0,01
USD 2.471.000	Dominican Republic International Bond 5,95% 25/1/2027	2.419.072	0,03	EUR 2.896.000	Altice France 5,875% 1/2/2027	2.546.781	0,04
USD 1.760.000	Dominican Republic International Bond 6,875% 29/1/2026	1.774.238	0,03	EUR 700.000	Arkema 1,5% 21/10/2025	684.590	0,01
USD 895.000	Dominican Republic International Bond 7,05% 3/2/2031*	889.303	0,01	EUR 1.700.000	Atos 0% 6/11/2024	1.555.158	0,02
		16.124.832	0,23	EUR 1.000.000	Atos 1,75% 7/5/2025*	894.266	0,01
	Égypte			EUR 2.000.000	AXA 4,25% 10/3/2043	2.002.917	0,03
EUR 581.000	Egypt Government International Bond 6,375% 11/4/2031	346.571	0,01	EUR 1.150.000	AXA 5,5% 11/7/2043	1.250.014	0,02
USD 1.923.000	Egypt Government International Bond 7,5% 16/2/2061	974.836	0,01	EUR 1.500.000	Banque Federative du Credit Mutuel 3,75% 1/2/2033	1.575.699	0,02
USD 1.447.000	Egypt Government International Bond 7,5% 16/2/2061	733.535	0,01	EUR 2.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel 4% 21/11/2029	2.275.810	0,03
USD 5.820.000	Egypt Government International Bond 7,625% 29/5/2032*	3.353.688	0,05	EUR 4.200.000	Banque Federative du Credit Mutuel 4,125% 14/6/2033*	4.529.179	0,06
USD 659.000	Egypt Government International Bond 7,903% 21/2/2048	337.052	0,00	GBP 4.500.000	Banque Federative du Credit Mutuel 4,875% 25/9/2025	5.562.942	0,08
				EUR 1.900.000	BNP Paribas 0,5% 1/9/2028	1.763.367	0,02
				EUR 1.500.000	BNP Paribas 0,875% 11/7/2030	1.325.735	0,02
				EUR 800.000	BNP Paribas 0,875% 31/8/2033	693.413	0,01
				GBP 1.000.000	BNP Paribas 1,875% 14/12/2027	1.060.032	0,01
				EUR 2.000.000	BNP Paribas 2,1% 7/4/2032	1.813.778	0,03
				EUR 2.000.000	BNP Paribas 2,75% 25/7/2028*	2.039.499	0,03
				GBP 2.000.000	BNP Paribas 3,375% 23/1/2026	2.376.638	0,03
				EUR 3.800.000	BNP Paribas 3,625% 1/9/2029	3.955.640	0,05
				EUR 2.900.000	BNP Paribas 3,875% 23/2/2029*	3.124.896	0,04
				EUR 3.500.000	BNP Paribas 4,125% 24/5/2033*	3.804.808	0,05
				USD 400.000	BNP Paribas 6,625% 25/3/2024	396.153	0,01
				USD 400.000	BNP Paribas 7,375% 19/8/2025*	391.684	0,01
				EUR 2.800.000	BPCE 4% 29/11/2032	2.992.552	0,04
				EUR 3.900.000	BPCE 4,75% 14/6/2034	4.240.701	0,06
				EUR 4.800.000	BPCE 5,125% 25/1/2035	5.071.242	0,07

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 600.000	Commerzbank 5,125% 18/1/2030*	646.309	0,01	EUR 1.851.591	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	1.975.969	0,03
EUR 1.000.000	Commerzbank 6,125% 9/10/2025	985.402	0,01	EUR 3.377.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	3.533.756	0,05
GBP 1.600.000	Commerzbank 8,625% 28/2/2033*	2.003.577	0,03	EUR 3.414.000	Tele Columbus 3,875% 2/5/2025*	2.376.673	0,03
EUR 3.100.000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1,875% 15/10/2024*	2.121.959	0,03	EUR 2.719.000	TK Elevator Midco 4,375% 15/7/2027	2.693.732	0,04
EUR 6.900.000	Deutsche Bahn Finance 0,95% 22/1/2025	6.910.121	0,10	EUR 1.652.000	TK Elevator Midco 8,413% 15/7/2027*	1.792.159	0,02
EUR 800.000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	779.164	0,01	EUR 900.000	Volkswagen Bank 4,25% 7/1/2026	973.199	0,01
EUR 2.200.000	Deutsche Bank 4,5% 30/11/2026	1.775.958	0,03	EUR 4.211.000	Volkswagen Leasing 0,625% 19/7/2029	3.672.165	0,05
EUR 200.000	Deutsche Bank 6,75% 30/10/2028*	179.558	0,00	EUR 400.000	ZF Finance 2% 6/5/2027	386.024	0,01
EUR 11.900.641	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,1% 15/4/2026*	15.754.622	0,22	EUR 400.000	ZF Finance 2,25% 3/5/2028*	371.984	0,00
EUR 500.000	Deutsche Lufthansa 1,625% 16/11/2023	538.480	0,01	EUR 800.000	ZF Finance 2,75% 25/5/2027	789.636	0,01
EUR 800.000	Deutsche Lufthansa 2,875% 16/5/2027	800.321	0,01	EUR 2.100.000	ZF Finance 3% 21/9/2025*	2.179.366	0,03
EUR 800.000	Deutsche Lufthansa 3,5% 14/7/2029	789.280	0,01	EUR 2.100.000	ZF Finance 5,75% 3/8/2026	2.294.311	0,03
EUR 500.000	Deutsche Lufthansa 3,75% 11/2/2028	509.767	0,01			142.317.007	1,97
EUR 900.000	DIC Asset 2,25% 22/9/2026	535.827	0,01	Ghana			
EUR 2.100.000	E.ON 3,5% 26/10/2037	2.119.001	0,03	USD 446.000	Ghana Government International Bond 6,375% 11/2/2027	195.102	0,00
EUR 1.300.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 1,125% 5/11/2029	1.339.955	0,02	USD 1.935.000	Ghana Government International Bond 7,625% 16/5/2029	838.513	0,01
EUR 5.500.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 2,125% 31/8/2081	4.281.910	0,06	USD 446.000	Ghana Government International Bond 8,625% 7/4/2034	197.081	0,01
EUR 400.000	FCT Autonomia DE 2023 4,792% 26/1/2043	433.280	0,01	USD 446.000	Ghana Government International Bond 8,95% 26/3/2051	191.780	0,00
EUR 300.000	FCT Autonomia DE 2023 5,742% 26/1/2043	324.646	0,00			1.422.476	0,02
EUR 100.000	FCT Autonomia DE 2023 6,692% 26/1/2043	108.076	0,00	Guatemala			
EUR 100.000	FCT Autonomia DE 2023 9,142% 26/1/2043	108.176	0,00	USD 2.028.000	Guatemala Government Bond 3,7% 7/10/2033	1.640.824	0,02
EUR 2.700.000	Fresenius 4,25% 28/5/2026*	2.930.640	0,04	USD 1.140.000	Guatemala Government Bond 4,65% 7/10/2041	898.434	0,01
EUR 1.373.000	Gruenthal 3,625% 15/11/2026*	1.415.543	0,02	USD 1.118.000	Guatemala Government Bond 5,25% 10/8/2029	1.065.208	0,02
EUR 1.006.000	Gruenthal 4,125% 15/5/2028	1.021.476	0,01	USD 1.280.000	Guatemala Government Bond 5,25% 10/8/2029	1.219.558	0,02
EUR 181.000	Gruenthal 6,75% 15/5/2030*	202.168	0,00	USD 3.003.000	Guatemala Government Bond 6,6% 13/6/2036*	3.016.514	0,04
EUR 5.100.000	Heidelberg Materials 3,75% 31/5/2032	5.236.115	0,07			7.840.538	0,11
EUR 1.851.000	HT Troplast 9,375% 15/7/2028	2.015.483	0,03	Hong Kong			
EUR 969.715	IHO Verwaltungs 3,875% 15/5/2027	956.442	0,01	USD 400.000	AIA 4,95% 4/4/2033	392.326	0,01
USD 200.000	IHO Verwaltungs 6% 15/5/2027	191.031	0,00	Hongrie			
EUR 346.000	IHO Verwaltungs 8,75% 15/5/2028	392.111	0,01	USD 2.270.000	Hungary Government International Bond 5,25% 16/6/2029	2.222.148	0,03
EUR 1.144.000	PCF 4,75% 15/4/2026*	967.901	0,01	USD 330.000	Hungary Government International Bond 5,375% 25/3/2024	329.436	0,00
EUR 1.156.000	PCF 8,413% 15/4/2026*	1.096.137	0,01	USD 1.375.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6,5% 29/6/2028	1.385.656	0,02
EUR 155.815	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,388% 15/9/2030	168.277	0,00			3.937.240	0,05
EUR 311.630	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,588% 15/9/2030	332.749	0,01	Inde			
EUR 77.908	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,988% 15/9/2030	82.526	0,00	USD 500.000	Export-Import Bank of India 3,875% 12/3/2024	494.985	0,01
EUR 2.415.000	Renk/Frankfurt am Main 5,75% 15/7/2025	2.600.570	0,04	USD 375.000	GMR Hyderabad International Airport 4,75% 2/2/2026	357.981	0,00
EUR 3.200.000	Robert Bosch 4,375% 2/6/2043*	3.470.853	0,05	USD 400.000	Oil India 5,125% 4/2/2029	391.502	0,01
				USD 400.000	Power Finance 4,5% 18/6/2029	372.232	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 200.000	REC 5,625% 11/4/2028	197.587	0,00	EUR 1.023.000	Aqueduct European CLO 7-2022 5,247% 15/3/2036	1.118.324	0,02
		1.814.287	0,03	EUR 2.490.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2,125% 15/8/2026	2.412.384	0,03
	Indonésie			GBP 2.150.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4,75% 15/7/2027	2.152.000	0,03
USD 300.000	Bank Negara Indonesia Persero 3,75% 30/3/2026	279.398	0,01	USD 2.271.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5,25% 30/4/2025	2.219.904	0,03
USD 2.655.000	Freeport Indonesia 4,763% 14/4/2027	2.561.809	0,04	EUR 1.200.000	Ares European CLO VII 5,163% 15/10/2030	1.276.480	0,02
USD 2.624.000	Indonesia Government International Bond 4,1% 24/4/2028	2.515.507	0,03	EUR 2.150.000	Ares European CLO X 6,463% 15/10/2031	2.217.313	0,03
USD 200.000	Indonesia Government International Bond 4,55% 11/1/2028*	196.037	0,00	EUR 858.000	Ares European CLO XII 5,405% 20/4/2032	912.527	0,01
USD 200.000	Indonesia Government International Bond 4,85% 11/1/2033*	196.237	0,00	EUR 875.000	Ares European CLO XII 6,705% 20/4/2032	906.676	0,01
USD 200.000	Indonesia Government International Bond 5,65% 11/1/2053	204.655	0,00	EUR 2.100.000	Armada Euro CLO III 6,963% 15/7/2031	2.205.857	0,03
USD 1.965.000	Indonesia Government International Bond 6,75% 15/1/2044*	2.253.187	0,03	USD 1.889.000	ASG Finance Designated Activity 7,875% 3/12/2024	1.843.475	0,03
IDR 50.682.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,375% 15/8/2028	3.356.060	0,05	GBP 1.541.946	Atom Mortgage 7,07% 22/7/2031	1.644.755	0,02
IDR 113.046.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/2/2033	7.752.891	0,11	EUR 499.059	Aurium CLO IV 4,393% 16/1/2031	533.196	0,01
IDR 161.028.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2038	11.223.323	0,16	EUR 900.000	Aurium CLO VIII 4,418% 23/6/2034	951.424	0,01
IDR 36.687.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029	2.629.275	0,04	EUR 550.000	Avoca CLO XIV 0% 12/1/2031	250.341	0,00
IDR 97.879.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2036	7.303.521	0,10	EUR 150.000	Avoca CLO XIV 8,361% 12/1/2031	154.899	0,00
IDR 23.950.000.000	Indonesia Treasury Bond 9% 15/3/2029	1.767.551	0,02	EUR 150.000	Avoca CLO XIV 10,011% 12/1/2031	143.350	0,00
USD 200.000	Pakuwon Jati 4,875% 29/4/2028	180.851	0,00	EUR 380.000	Avoca CLO XV 7,793% 15/4/2031	366.411	0,01
USD 510.000	Pertamina Geothermal Energy 5,15% 27/4/2028	504.262	0,01	EUR 350.000	Avoca CLO XVIII 5,413% 15/4/2031	369.570	0,01
USD 2.764.000	Pertamina Persero 3,65% 30/7/2029*	2.532.077	0,03	EUR 290.000	Avoca CLO XXII 4,963% 15/4/2035	302.146	0,00
USD 600.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3,8% 23/6/2050*	463.341	0,01	EUR 1.000.000	Avoca CLO XXIII 6,713% 15/4/2034	1.024.431	0,01
USD 1.432.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,4% 6/6/2027*	1.401.527	0,02	EUR 1.459.000	Bank of Ireland 7,5% 19/5/2025	1.554.490	0,02
		47.321.509	0,66	EUR 250.000	Bluemountain Euro 2021-2 CLO 5,413% 15/10/2035	264.359	0,00
	International			EUR 900.000	BlueMountain Fuji CLO III 6,563% 15/1/2031	927.117	0,01
EUR 300.000	European Union 2,5% 4/10/2052	270.680	0,00	EUR 800.000	BlueMountain Fuji Eur CLO IV 10,036% 25/2/2034	811.446	0,01
EUR 662.000	European Union 2,625% 4/2/2048	635.254	0,01	EUR 300.000	Bridgepoint CLO 1 7,913% 15/1/2034	322.514	0,00
EUR 1.122.400	European Union 3% 4/3/2053	1.123.633	0,02	EUR 2.300.000	Bridgepoint CLO IV 5,905% 20/1/2037	2.504.694	0,03
		2.029.567	0,03	EUR 582.000	Capital Four CLO III 9,723% 15/10/2034	584.098	0,01
	Irlande			EUR 1.517.000	Capital Four CLO V 5,331% 25/4/2036	1.648.215	0,02
USD 1.289.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 5,75% 6/6/2028	1.276.737	0,02	EUR 400.000	CIFC European Funding CLO I 9,523% 15/7/2032	401.327	0,01
GBP 899.664	Agora UK 2021 6,37% 22/7/2031	1.097.692	0,02	EUR 400.000	CIFC European Funding CLO II 5,263% 15/4/2033	423.559	0,01
EUR 1.098.000	AIB 5,25% 9/10/2024	1.120.389	0,01	EUR 500.000	CIFC European Funding CLO III 6,163% 15/1/2034	520.869	0,01
EUR 2.300.000	AIB 6,25% 23/6/2025*	2.378.092	0,03	EUR 1.500.000	CIFC European Funding CLO IV 4,61% 18/8/2035	1.583.059	0,02
EUR 2.680.000	Alme Loan Funding V 9,073% 15/7/2031	2.837.414	0,04	EUR 1.580.000	Clontarf Park CLO 6,772% 5/8/2030	1.713.609	0,02
EUR 838.000	Anchorage Capital Europe CLO 2 5,263% 15/4/2034	883.577	0,01	EUR 539.000	Contego CLO IX 9,708% 24/1/2034	540.948	0,01
EUR 1.000.000	Aqueduct European CLO 5-2020 5,705% 20/4/2034	1.017.947	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 2.400.000	Contego CLO VI 4,453% 15/4/2034	2.540.630	0,04	EUR 589.438	Lt Autorahoitus IV 4,313% 18/7/2033	640.677	0,01
EUR 800.000	Contego CLO VIII 9,781% 25/1/2034	803.978	0,01	EUR 1.200.000	Lt Autorahoitus IV 5,673% 18/7/2033	1.306.062	0,02
EUR 2.800.000	CRH SMW Finance 4% 11/7/2031	3.016.973	0,04	EUR 1.250.000	Madison Park Euro Funding XVI 6,863% 25/5/2034	1.276.742	0,02
EUR 1.750.000	CVC Cordatus Loan Fund 6,548% 20/5/2036	1.898.623	0,03	EUR 1.050.000	Man GLG Euro CLO VI 7,163% 15/10/2032	1.084.216	0,02
EUR 330.000	CVC Cordatus Loan Fund IV 5,116% 22/2/2034	342.950	0,01	EUR 1.606.000	Margay CLO I 5,8% 15/7/2036	1.756.153	0,02
EUR 400.000	CVC Cordatus Loan Fund V 5,146% 21/7/2030	426.751	0,01	EUR 142.000	Margay CLO I 10,25% 15/7/2036	156.293	0,00
EUR 400.000	CVC Cordatus Loan Fund XIX 7,368% 23/12/2033	423.599	0,01	EUR 150.000	Marino Park CLO 9,333% 16/1/2034	151.729	0,00
EUR 250.000	Euro-Galaxy III CLO 6,048% 24/4/2034	264.467	0,00	EUR 188.000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 9,183% 17/4/2034	190.572	0,00
EUR 510.000	Euro-Galaxy III CLO 6,948% 24/4/2034	534.839	0,01	EUR 699.000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 2 9,723% 15/4/2034	703.731	0,01
EUR 1.510.000	Fidelity Grand Harbour CLO 2021-1 7,263% 15/10/2034	1.529.576	0,02	EUR 250.000	Northwoods Capital 19 Euro 6,326% 25/11/2033	262.718	0,00
EUR 2.600.000	Fidelity Grand Harbour CLO 2023-1 5,678% 15/8/2036	2.831.173	0,04	EUR 425.000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 5,546% 21/1/2035	449.611	0,01
EUR 149.000	Fidelity Grand Harbour CLO 2023-1 9,678% 15/8/2036	165.337	0,00	EUR 450.000	OAK Hill European Credit Partners VI 4,905% 20/1/2032	475.807	0,01
GBP 456.719	Frost CMBS 2021-1 6,568% 20/11/2033	565.930	0,01	EUR 800.000	OCP Euro CLO 2017-2 5,013% 15/1/2032	850.928	0,01
EUR 550.000	Glencore Capital Finance 1,25% 1/3/2033*	434.743	0,01	EUR 250.000	OCP Euro CLO 2019-3 6,005% 20/4/2033	262.012	0,00
EUR 700.000	Harvest CLO XVIII 4,863% 15/10/2030	738.958	0,01	EUR 250.000	OCP Euro CLO 2019-3 7,005% 20/4/2033	258.907	0,00
EUR 390.000	Harvest CLO XXIII 6,705% 20/10/2032	397.544	0,01	EUR 2.500.000	Palmer Square European CLO 2023-1 5,75% 15/7/2036	2.721.810	0,04
EUR 714.793	Haus European Loan Conduit No 39 4,364% 28/7/2051	730.768	0,01	EUR 300.000	Palmer Square European CLO 2023-1 10,05% 15/7/2036	331.153	0,00
EUR 210.939	Haus European Loan Conduit No 39 4,814% 28/7/2051	204.849	0,00	EUR 1.128.144	Pearl Finance 2020 5,687% 17/11/2032	1.198.849	0,02
EUR 840.757	Haus European Loan Conduit No 39 5,114% 28/7/2051	752.266	0,01	EUR 1.354.717	Pearl Finance 2020 6,287% 17/11/2032	1.431.212	0,02
EUR 130.000	Henley CLO IV 5,071% 25/4/2034	136.311	0,00	EUR 650.000	Penta CLO 11 6,231% 15/11/2034	701.598	0,01
EUR 250.000	Henley CLO IV 6,721% 25/4/2034	255.063	0,00	EUR 470.000	Penta CLO 11 8,581% 15/11/2034	508.924	0,01
EUR 450.000	Invesco Euro CLO III 5,413% 15/7/2032	471.193	0,01	EUR 500.000	Penta CLO 6 5,421% 25/7/2034	526.490	0,01
EUR 197.049	Invesco Euro CLO III 11,733% 15/7/2032	192.574	0,00	EUR 500.000	Penta CLO 6 6,021% 25/7/2034	522.325	0,01
EUR 625.000	Invesco Euro CLO IV 5,363% 15/4/2033	657.454	0,01	USD 1.193.387	Prodigy Finance CM2021-1 6,679% 25/7/2051	1.185.312	0,02
EUR 1.600.000	Invesco Euro CLO IX 4,756% 20/4/2036	1.731.402	0,02	USD 488.586	Prodigy Finance CM2021-1 7,929% 25/7/2051	484.539	0,01
GBP 1.816.000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 8,636% 17/8/2033	2.302.628	0,03	USD 286.769	Prodigy Finance CM2021-1 9,179% 25/7/2051	285.368	0,00
GBP 1.569.000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 9,636% 17/8/2033	1.989.689	0,03	USD 433.454	Prodigy Finance CM2021-1 11,329% 25/7/2051	435.507	0,01
EUR 565.547	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4,537% 17/8/2033	588.433	0,01	EUR 439.075	River Green Finance 2020 4,748% 22/1/2032	451.811	0,01
EUR 344.632	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4,837% 17/8/2033	347.941	0,01	EUR 318.450	River Green Finance 2020 5,098% 22/1/2032	327.269	0,00
EUR 1.331.397	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,187% 17/8/2033	1.352.190	0,02	EUR 2.657.000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 5,397% 20/12/2031	2.847.443	0,04
EUR 1.030.949	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,687% 17/8/2033	1.013.895	0,01	EUR 710.000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 6,017% 20/12/2031	752.236	0,01
EUR 660.864	Last Mile PE 2021 4,687% 17/8/2031	692.361	0,01	EUR 2.480.000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 5,305% 20/1/2033	2.607.990	0,04
EUR 938.803	Last Mile PE 2021 4,987% 17/8/2031	957.184	0,01	EUR 976.000	RRE 5 Loan Management 5,413% 15/1/2037	1.032.680	0,01
EUR 1.060.777	Last Mile PE 2021 5,387% 17/8/2031	1.060.608	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 599.000	Telecom Italia 2,75% 15/4/2025	625.593	0,01	GBP 457.000	CPUK Finance 4,875% 28/8/2025	554.151	0,01
EUR 400.000	Telecom Italia 2,875% 28/1/2026	413.134	0,01	GBP 4.551.000	Galaxy Bidco 6,5% 31/7/2026	5.313.895	0,07
EUR 200.000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	209.770	0,00	GBP 1.600.000	Glencore Finance Europe 3,125% 26/3/2026	1.893.351	0,03
EUR 685.000	Telecom Italia 4% 11/4/2024	739.312	0,01	GBP 3.105.000	Heathrow Funding 2,625% 16/3/2028	3.289.841	0,04
EUR 3.469.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	3.805.960	0,05	GBP 327.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 5,844% 5/11/2031	414.866	0,01
EUR 489.000	Telecom Italia 7,875% 31/7/2028	552.237	0,01	GBP 1.469.898	Intu Jersey 2 2,875% 1/11/2022***	334.968	0,00
EUR 700.000	UniCredit 2,731% 15/1/2032*	680.667	0,01	GBP 861.000	Kane Bidco 6,5% 15/2/2027	999.831	0,01
EUR 1.025.000	UniCredit 4,45% 16/2/2029	1.092.513	0,02	USD 270.000	Pikes Peak CLO 12 14,087% 20/4/2036	271.027	0,00
EUR 300.000	UniCredit 4,875% 20/2/2029	324.670	0,00			17.012.934	0,23
EUR 400.000	UniCredit 5,375% 3/6/2025*	405.770	0,01				
USD 1.900.000	UniCredit 7,296% 2/4/2034*	1.817.907	0,03				
EUR 1.000.000	UniCredit 7,5% 3/6/2026*	1.087.658	0,01				
		97.620.568	1,35				
	Jamaïque				Jordanie		
USD 553.557	Digicel International Finance/ Digicel international 8% 31/12/2026***	32.867	0,00	USD 978.000	Jordan Government International Bond 4,95% 7/7/2025	954.944	0,01
USD 1.386.646	Digicel International Finance/ Digicel international 8,75% 25/5/2024	1.270.355	0,02	USD 3.176.000	Jordan Government International Bond 5,85% 7/7/2030	2.938.260	0,04
USD 843.566	Digicel International Finance/ Digicel international 13% 31/12/2025***	603.150	0,01			3.893.204	0,05
USD 715.000	Jamaica Government International Bond 6,75% 28/4/2028	739.564	0,01		Kenya		
		2.645.936	0,04	USD 3.263.000	Republic of Kenya Government International Bond 8% 22/5/2032*	2.712.369	0,04
	Japon				Luxembourg		
JPY 40.000.000	Daifuku 0% 14/9/2028	290.308	0,00	EUR 4.918.000	Adler Financing 12,5% 30/6/2025	5.510.080	0,08
EUR 4.760.000	East Japan Railway 2,614% 8/9/2025	5.039.492	0,07	EUR 2.946.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3,625% 1/6/2028*	2.624.759	0,04
EUR 5.100.000	East Japan Railway 4,11% 22/2/2043	5.398.766	0,07	GBP 418.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,875% 1/6/2028*	421.436	0,00
USD 3.000.000	Mizuho Financial 3,261% 22/5/2030	2.635.321	0,04	EUR 1.822.000	Altice Financing 2,25% 15/1/2025	1.892.757	0,03
EUR 820.000	Nissan Motor 2,652% 17/3/2026	844.901	0,01	EUR 100.000	Altice Financing 3% 15/1/2028	84.516	0,00
EUR 1.280.000	Nissan Motor 3,201% 17/9/2028	1.268.487	0,02	EUR 672.000	Altice Financing 4,25% 15/8/2029	557.595	0,01
USD 4.900.000	Rakuten 3,546% 27/11/2024*	4.538.625	0,06	EUR 400.000	Aroundtown 3,375% 23/9/2024	181.858	0,00
USD 905.000	Rakuten 10,25% 30/11/2024	913.991	0,01	GBP 1.381.000	Aroundtown 4,75% 25/6/2024	683.444	0,01
EUR 2.288.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	2.401.120	0,03	USD 2.307.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	23.070	0,00
EUR 1.785.000	SoftBank 3,125% 19/9/2025*	1.840.996	0,03	USD 529.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	5.290	0,00
EUR 1.815.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032	1.542.744	0,02	EUR 528.000	BL Consumer Credit 2021 4,742% 25/9/2038	569.344	0,01
USD 1.000.000	SoftBank 4% 6/7/2026*	916.250	0,01	EUR 681.000	BL Consumer Credit 2021 5,292% 25/9/2038	731.610	0,01
EUR 400.000	SoftBank 4,5% 20/4/2025	426.160	0,01	EUR 356.000	BL Consumer Credit 2021 6,492% 25/9/2038	380.109	0,00
USD 300.000	SoftBank 4,75% 19/9/2024*	289.875	0,00	EUR 1.070.000	Cidron Aida Finco 5% 1/4/2028	1.065.808	0,01
EUR 1.181.000	SoftBank 4,75% 30/7/2025	1.256.969	0,02	GBP 3.015.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	3.377.451	0,05
USD 300.000	SoftBank 6% 30/7/2025	294.375	0,01	EUR 1.626.000	Cirsa Finance International 4,75% 22/5/2025	1.745.827	0,02
USD 2.487.000	Sumitomo Mitsui Financial 2,472% 14/1/2029	2.130.382	0,03	EUR 771.000	Cirsa Finance International 7,875% 31/7/2028	842.189	0,01
USD 4.085.000	Takeda Pharmaceutical 2,05% 31/3/2030	3.359.276	0,05	EUR 896.000	Cirsa Finance International 8,185% 31/7/2028	971.377	0,01
JPY 80.000.000	Tokyu 0% 29/9/2028	572.406	0,01	USD 5.423.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	5.147.588	0,07
JPY 80.000.000	Tokyu 0% 30/9/2030	575.690	0,01	USD 363.000	CSN Resources 5,875% 8/4/2032	293.304	0,00
		36.536.134	0,51	EUR 1.650.000	Cullinan Holdco Scsp 4,625% 15/10/2026*	1.501.353	0,02
	Jersey						
USD 1.500.000	Aptiv / Aptiv 2,396% 18/2/2025	1.427.890	0,02				
USD 1.500.000	Aptiv / Aptiv 3,25% 1/3/2032	1.272.290	0,02				
GBP 678.000	CPUK Finance 3,588% 28/8/2025	806.587	0,01				
GBP 392.000	CPUK Finance 4,5% 28/8/2027*	434.237	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 800.000	Cullinan Holdco Scsp 8,413% 15/10/2026*	812.726	0,01			92.929.375	1,28
EUR 1.378.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	1.533.298	0,02	USD 885.000	Malaisie Khazanah Capital 4,876% 1/6/2033	863.149	0,01
USD 909.000	EIG Pearl 3,545% 31/8/2036*	757.365	0,01	USD 895.000	Khazanah Global Sukuk 4,687% 1/6/2028	881.526	0,01
USD 3.570.000	EIG Pearl 4,387% 30/11/2046	2.707.595	0,04	USD 500.000	TNB Global Ventures Capital 3,244% 19/10/2026	468.515	0,01
EUR 2.300.000	European TopSoho 4% 21/9/2021***	1.921.438	0,03			2.213.190	0,03
EUR 400.000	FACT Master 4,582% 20/7/2028	430.436	0,00				
EUR 4.449.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	3.740.188	0,05	USD 1.707.000	Îles Marshall Danaos 8,5% 1/3/2028	1.728.998	0,02
GBP 1.814.000	Garfunkelux Holdco 3 7,75% 1/11/2025*	1.755.900	0,03				
EUR 1.759.883	Germany Compartment Consumer 2020-1 5,371% 14/11/2034	1.908.197	0,03	USD 333.000	Maurice CA Magnum 5,375% 31/10/2026	299.114	0,01
EUR 639.957	Germany Compartment Consumer 2020-1 6,121% 14/11/2034	691.021	0,01	USD 730.000	Diamond II 7,95% 28/7/2026	719.158	0,01
EUR 2.111.000	Herens Midco 5,25% 15/5/2029*	1.234.505	0,01	USD 1.025.000	HTA 7% 18/12/2025*	972.746	0,01
USD 293.000	Kenbourne Invest 4,7% 22/1/2028	178.730	0,00	USD 744.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024	732.840	0,01
USD 4.035.000	Kenbourne Invest 6,875% 26/11/2024	3.396.502	0,05	USD 292.000	India Green Power 4% 22/2/2027	258.665	0,00
USD 628.000	Kenbourne Invest 6,875% 26/11/2024	528.902	0,01	USD 300.000	Network i2i 3,975% 3/3/2026*	275.398	0,00
USD 1.079.000	Kernel 6,5% 17/10/2024	772.197	0,01	USD 481.000	Network i2i 5,65% 15/1/2025	468.213	0,01
USD 875.000	Kernel 6,75% 27/10/2027	533.737	0,01			3.726.134	0,05
EUR 244.000	Kleopatra 2 6,5% 1/9/2026	166.567	0,00				
EUR 1.056.330	LHMC Finco 2 7,25% 2/10/2025*	1.145.040	0,02				
EUR 395.000	Lion/Polaris Lux 4 7,526% 1/7/2026	425.241	0,01	USD 930.000	Mexique Banco Mercantil del Norte 5,875% 24/1/2027	821.236	0,01
USD 1.832.979	MC Brazil Downstream Trading 7,25% 30/6/2031	1.190.410	0,02	USD 1.571.000	Braskem Idesa SAPI 6,99% 20/2/2032	937.628	0,01
USD 2.579.892	MC Brazil Downstream Trading 7,25% 30/6/2031	1.675.485	0,02	EUR 998.000	Cemex 3,125% 19/3/2026*	1.050.557	0,01
EUR 1.080.000	Medtronic Global 2,625% 15/10/2025	1.143.250	0,01	USD 4.127.000	Comision Federal de Electricidad 4,875% 15/1/2024	4.102.382	0,06
USD 2.221.000	Medtronic Global 4,25% 30/3/2028	2.156.401	0,03	USD 1.492.000	Gruma 4,875% 1/12/2024*	1.473.716	0,02
USD 853.000	MHP Lux 6,25% 19/9/2029	472.895	0,01	USD 1.220.000	Grupo Bimbo 3,875% 27/6/2024*	1.202.310	0,02
USD 810.000	MHP Lux 6,95% 3/4/2026	474.401	0,01	USD 814.000	Grupo Posadas 5% 30/12/2027	698.139	0,01
USD 1.519.200	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028	1.368.229	0,02	USD 1.207.000	Metalsa Sapi 3,75% 4/5/2031*	941.020	0,01
USD 1.412.100	Millicom International Cellular 6,625% 15/10/2026*	1.382.107	0,02	MXN 148.600.000	Mexican Bonos 7,5% 3/6/2027	8.272.296	0,11
EUR 538.000	Monitchem HoldCo 3 8,75% 1/5/2028	578.725	0,01	MXN 257.066.100	Mexican Bonos 7,5% 26/5/2033	13.582.320	0,19
USD 4.135.000	Puma International Financing 5% 24/1/2026*	3.807.549	0,05	MXN 264.935.000	Mexican Bonos 7,75% 29/5/2031	14.412.529	0,20
USD 548.000	Puma International Financing 5,125% 6/10/2024	543.063	0,01	MXN 551.710.000	Mexican Bonos 8,5% 31/5/2029	31.665.767	0,44
EUR 4.230.000	Rossini 6,75% 30/10/2025	4.629.475	0,06	MXN 202.201.200	Mexican Bonos 8,5% 18/11/2038	11.171.784	0,15
EUR 400.000	Rossini 7,589% 30/10/2025*	435.037	0,01	MXN 3.579.025.400	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	19.394.376	0,27
EUR 12.651.000	SES 2,875% 27/5/2026	11.970.819	0,17	MXN 1.190.127.800	Mexico Cetes 0% 3/10/2024	6.324.526	0,09
EUR 1.700.000	SES 5,625% 29/1/2024	1.845.698	0,02	MXN 5.180.900.000	Mexico Cetes 0% 28/11/2024	27.104.931	0,38
EUR 1.200.000	Stena International 7,25% 15/2/2028*	1.346.897	0,02	USD 2.858.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	2.366.624	0,03
EUR 3.918.000	Summer BC Holdco B 5,75% 31/10/2026*	3.864.416	0,05	USD 2.134.000	Mexico Government International Bond 3,75% 11/1/2028	2.024.579	0,03
USD 143.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	118.781	0,00	USD 1.610.000	Mexico Government International Bond 6,338% 4/5/2053	1.605.170	0,02
USD 603.000	Tupy Overseas 4,5% 16/2/2031	488.234	0,01	USD 355.000	Mexico Government International Bond 6,35% 9/2/2035	368.701	0,00
EUR 200.000	Vivion Investments 3% 8/8/2024	187.153	0,00	USD 604.000	Nemak 3,625% 28/6/2031*	462.277	0,01
				EUR 137.000	Petroleos Mexicanos 3,625% 24/11/2025	132.894	0,00
				EUR 534.000	Petroleos Mexicanos 3,75% 21/2/2024	571.145	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.778.000	Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030	2.417.596	0,03	EUR 874.353	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos 0,7% 12/2/2024	938.893	0,02
USD 905.000	Panama Government International Bond 3,875% 17/3/2028	852.044	0,01	EUR 687.541	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Ulisses Finance No. 2 6,462% 23/9/2038	700.143	0,01
USD 5.012.000	Panama Government International Bond 6,4% 14/2/2035	5.146.867	0,07	EUR 143.558	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 4,582% 28/10/2040	152.446	0,00
USD 3.257.000	Panama Government International Bond 6,853% 28/3/2054*	3.318.231	0,05	EUR 502.451	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 5,182% 28/10/2040	523.064	0,01
		13.466.641	0,19			12.054.471	0,17
	Paraguay				Porto Rico		
USD 1.565.000	Frigorifico Concepcion 7,7% 21/7/2028	1.335.407	0,02	USD 590.000	Puerto Rico Sales Tax Financing Sales Tax Revenue 4,75% 1/7/2053	548.262	0,01
USD 2.095.000	Paraguay Government International Bond 5,6% 13/3/2048	1.800.401	0,03				
		3.135.808	0,05		Qatar		
	Pérou			USD 500.000	Qatar Government International Bond 4% 14/3/2029*	483.533	0,01
USD 1.975.000	Financiera de Desarrollo 4,75% 15/7/2025	1.937.011	0,02				
USD 4.021.000	Peruvian Government International Bond 1,862% 1/12/2032	3.036.257	0,04		Roumanie		
USD 2.111.000	Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031	1.792.228	0,03	EUR 2.800.000	RCS & RDS 2,5% 5/2/2025	2.914.707	0,04
		6.765.496	0,09	EUR 2.348.000	Romanian Government International Bond 2,124% 16/7/2031*	1.940.712	0,03
	Philippines			EUR 3.556.000	Romanian Government International Bond 2,125% 7/3/2028	3.395.174	0,05
PHP 148.600.000	Philippine Government Bond 7% 13/7/2038	2.748.151	0,04	EUR 2.469.000	Romanian Government International Bond 2,5% 8/2/2030	2.242.606	0,03
USD 400.000	Philippine Government International Bond 2,65% 10/12/2045	259.596	0,00	EUR 2.348.000	Romanian Government International Bond 2,875% 11/3/2029*	2.248.330	0,03
USD 1.000.000	Rizal Commercial Banking 6,5% 27/8/2025	916.040	0,01	USD 2.262.000	Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027	2.223.026	0,03
		3.923.787	0,05			14.964.555	0,21
	Pologne				Fédération de Russie		
USD 3.287.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375% 22/5/2033	3.225.369	0,05	RUB 352.509.000	Russian Federal Bond - OFZ 6,1% 18/7/2035	1.028.526	0,01
EUR 1.261.000	Republic of Poland Government International Bond 4,25% 14/2/2043	1.337.354	0,02		Arabie Saoudite		
USD 947.000	Republic of Poland Government International Bond 4,875% 4/10/2033*	919.475	0,01	USD 129.000	Saudi Government International Bond 3,25% 26/10/2026	122.043	0,00
USD 1.447.000	Republic of Poland Government International Bond 5,5% 4/4/2053	1.410.232	0,02	USD 3.503.000	Saudi Government International Bond 3,45% 2/2/2061	2.332.560	0,03
		6.892.430	0,10	USD 2.636.000	Saudi Government International Bond 4,5% 17/4/2030	2.572.776	0,04
	Portugal			USD 2.089.000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053*	1.859.993	0,03
EUR 164.670	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 5,887% 25/1/2035	176.041	0,00			6.887.372	0,10
EUR 713.570	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 7,887% 25/1/2035	759.147	0,01		Sénégal		
EUR 200.000	Banco Espirito Santo 2,625% 8/5/2017***	46.653	0,00	EUR 296.000	Senegal Government International Bond 4,75% 13/3/2028*	277.423	0,00
EUR 20.500.000	Banco Espirito Santo 4% 21/1/2019***	4.781.896	0,06	EUR 419.000	Senegal Government International Bond 5,375% 8/6/2037	304.684	0,00
EUR 2.000.000	Banco Espirito Santo 4,75% 15/1/2018***	466.526	0,01	USD 1.366.000	Senegal Government International Bond 6,25% 23/5/2033*	1.120.543	0,02
EUR 3.500.000	EDP - Energias de Portugal 1,7% 20/7/2080	3.509.662	0,05				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 473.000	Senegal Government International Bond 6,75% 13/3/2048	330.043	0,01	EUR 244.215	Autonoria Spain 2021 FT 4,442% 31/1/2039	261.725	0,00
		2.032.693	0,03	EUR 1.282.130	Autonoria Spain 2021 FT 4,692% 31/1/2039	1.361.801	0,02
	Singapour			EUR 549.485	Autonoria Spain 2021 FT 5,192% 31/1/2039	581.505	0,01
USD 343.000	ABJA Investment 5,45% 24/1/2028	336.967	0,00	EUR 305.269	Autonoria Spain 2021 FT 6,292% 31/1/2039	319.931	0,01
USD 1.178.000	Continuum Energy Aura 9,5% 24/2/2027	1.171.390	0,02	EUR 122.108	Autonoria Spain 2021 FT 7,542% 31/1/2039	126.973	0,00
USD 1.029.394	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027	961.197	0,01	EUR 261.052	Autonoria Spain 2022 FT 6,442% 27/1/2040	285.795	0,00
USD 187.162	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027*	174.763	0,00	EUR 87.017	Autonoria Spain 2022 FT 7,842% 28/1/2040	95.731	0,00
USD 600.000	DBS 3,3% 27/2/2025	569.439	0,01	EUR 435.087	Autonoria Spain 2022 FT 10,642% 29/1/2040	479.075	0,01
USD 482.760	LLPL Capital 6,875% 4/2/2039*	428.630	0,01	EUR 1.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/3/2024	1.717.928	0,02
USD 5.105.000	Pfizer Investment Enterprises 4,65% 19/5/2025	5.047.977	0,07	EUR 900.000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030*	910.272	0,01
USD 2.383.000	Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	2.347.342	0,03	EUR 1.700.000	Banco de Sabadell 2,5% 15/4/2031	1.648.632	0,02
USD 2.280.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	2.284.727	0,03	EUR 1.100.000	Banco de Sabadell 2,625% 24/3/2026	1.150.392	0,02
SGD 1.000.000	Straits Trading 3,25% 13/2/2028	651.022	0,01	EUR 1.000.000	Banco de Sabadell 5,25% 7/2/2029	1.078.517	0,01
USD 200.000	TML 4,35% 9/6/2026	184.562	0,00	GBP 2.300.000	Banco Santander 3,125% 6/10/2026	2.697.928	0,04
		14.158.016	0,19	EUR 8.000.000	Banco Santander 3,625% 27/9/2026	8.577.534	0,12
	Afrique du Sud			EUR 1.100.000	Banco Santander 3,75% 16/1/2026	1.183.212	0,02
ZAR 83.331.646	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	3.979.481	0,05	EUR 2.400.000	Banco Santander 3,875% 16/1/2028	2.578.390	0,04
ZAR 36.835.021	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 31/1/2044*	1.426.784	0,02	EUR 200.000	Banco Santander 4,213% 16/1/2025	217.417	0,00
ZAR 206.119.562	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	8.404.662	0,12	EUR 2.400.000	Banco Santander 4,375% 14/1/2026*	2.190.010	0,03
ZAR 193.874.767	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026	10.796.190	0,15	EUR 1.200.000	Banco Santander 5,75% 23/8/2033	1.299.149	0,02
USD 2.154.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,85% 30/9/2029*	1.900.841	0,03	EUR 700.000	Bankinter 4,375% 3/5/2030	758.322	0,01
USD 3.442.000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	2.289.756	0,03	EUR 800.000	CaixaBank 6,375% 19/9/2023*	870.126	0,01
USD 2.075.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 20/4/2032*	1.841.334	0,02	EUR 600.000	CaixaBank 6,75% 13/6/2024	641.746	0,01
		30.639.048	0,42	EUR 1.100.000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	1.039.403	0,02
	Corée du Sud			EUR 1.400.000	Cellnex Finance 1,5% 8/6/2028*	1.319.299	0,02
USD 1.760.000	GS Caltex 5,375% 7/8/2028	1.747.451	0,02	EUR 2.700.000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033*	2.306.888	0,03
USD 400.000	Kookmin Bank 4,35% 2/7/2024	390.302	0,01	USD 200.000	Cellnex Finance 3,875% 7/7/2041	142.264	0,00
USD 200.000	Korea National Oil 4,75% 3/4/2026	196.756	0,00	EUR 4.700.000	Cellnex Telecom 0,75% 20/11/2031	3.922.184	0,05
USD 200.000	Korea National Oil 4,875% 3/4/2028	197.562	0,01	EUR 1.700.000	Cellnex Telecom 1,75% 23/10/2030*	1.514.498	0,02
USD 360.000	LG Chem 2,375% 7/7/2031	289.713	0,00	EUR 700.000	Cellnex Telecom 1,875% 26/6/2029	650.494	0,01
USD 538.000	POSCO 5,625% 17/1/2026*	538.498	0,01	EUR 200.000	Cellnex Telecom 2,125% 11/8/2030	210.989	0,00
USD 582.000	POSCO 5,75% 17/1/2028	586.254	0,01	EUR 741.000	Food Service Project 5,5% 21/1/2027*	767.297	0,01
USD 200.000	POSCO 5,875% 17/1/2033*	206.239	0,00	EUR 233.185	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3,5% 21/3/2033	238.845	0,00
USD 400.000	SK Hynix 6,25% 17/1/2026*	401.652	0,01	EUR 388.642	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 4,522% 21/3/2033	417.140	0,01
USD 1.765.000	SK Hynix 6,375% 17/1/2028	1.786.127	0,03	EUR 116.593	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5,522% 21/3/2033	124.540	0,00
USD 200.000	SK Hynix 6,375% 17/1/2028*	202.394	0,00	EUR 729.000	Grupo Antolin-Irausa 3,5% 30/4/2028	586.095	0,01
USD 250.000	SK Hynix 6,5% 17/1/2033	253.439	0,00	GBP 600.000	Iberdrola Finanzas 7,375% 29/1/2024	764.819	0,01
		6.796.387	0,10				
	Espagne						
USD 1.304.682	Al Candelaria Spain 7,5% 15/12/2028	1.212.415	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 6.400.000	Agps Bondco 6% 5/8/2025	2.700.733	0,04	GBP 2.575.000	British Telecommunications 8,375% 20/12/2083	3.269.307	0,05
EUR 1.036.000	Allwyn Entertainment Financing UK 7,25% 30/4/2030	1.148.267	0,02	GBP 225.000	Canada Square Funding 2021-2 6,214% 17/6/2058	280.579	0,00
EUR 2.400.000	Anglo American Capital 1,625% 18/9/2025*	2.485.132	0,04	GBP 102.000	Canada Square Funding 2021-2 6,614% 17/6/2058	126.200	0,00
EUR 710.000	Anglo American Capital 4,5% 15/9/2028*	772.965	0,01	GBP 318.000	Canada Square Funding 6 6,601% 17/1/2059	385.623	0,01
EUR 3.300.000	Anglo American Capital 4,75% 21/9/2032*	3.538.322	0,05	GBP 178.000	Canada Square Funding 6 7,001% 17/1/2059	210.072	0,00
EUR 4.170.000	Anglo American Capital 5% 15/3/2031*	4.556.660	0,06	GBP 1.000.000	Canary Wharf Finance II 6,684% 22/10/2037	1.032.141	0,01
GBP 125.000	Atlas Funding 2021-1 6,874% 25/7/2058	158.073	0,00	GBP 4.190.000	Canary Wharf Finance II 7,409% 22/10/2037	4.202.176	0,06
GBP 110.000	Atlas Funding 2021-1 7,424% 25/7/2058	138.987	0,00	EUR 200.000	Carnival 1% 28/10/2029	145.651	0,00
GBP 877.248	Atlas Funding 2023-1 6,345% 20/1/2061	1.113.542	0,02	EUR 1.071.000	Chanel Ceres 0,5% 31/7/2026	1.045.564	0,01
GBP 304.000	Atlas Funding 2023-1 7,095% 20/1/2061	384.202	0,01	EUR 2.404.000	Channel Link Enterprises Finance 2,706% 30/6/2050	2.384.307	0,03
GBP 200.000	Atlas Funding 2023-1 7,945% 20/1/2061	252.108	0,00	GBP 1.850.000	Channel Link Enterprises Finance 3,043% 30/6/2050	1.959.093	0,03
GBP 103.000	Atlas Funding 2023-1 8,995% 20/1/2061	130.018	0,00	GBP 220.000	CMF 2020-1 6,196% 16/1/2057	278.500	0,00
USD 1.611.422	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	1.411.533	0,02	GBP 105.000	CMF 2020-1 6,446% 16/1/2057	132.706	0,00
GBP 744.865	Azure Finance NO 2 8,195% 20/7/2030	946.221	0,01	GBP 898.000	Constellation Automotive Financing 4,875% 15/7/2027*	912.860	0,01
EUR 400.000	Babcock International 1,375% 13/9/2027	387.114	0,01	GBP 1.030.947	Dignity Finance 3,546% 31/12/2034	1.151.924	0,02
GBP 2.000.000	Babcock International 1,875% 5/10/2026	2.224.338	0,03	GBP 350.000	Dignity Finance 4,696% 31/12/2049	280.413	0,00
GBP 1.000.000	Barclays 3% 8/5/2026	1.159.665	0,02	GBP 18.962	Dowson 2021-2 5,875% 20/10/2028	24.040	0,00
GBP 1.000.000	Barclays 3,25% 12/2/2027	1.138.349	0,02	GBP 400.000	Dowson 2021-2 6,395% 20/10/2028	507.174	0,01
GBP 1.000.000	Barclays 3,75% 22/11/2030	1.157.096	0,02	GBP 1.300.000	Dowson 2021-2 6,795% 20/10/2028	1.644.674	0,02
EUR 1.790.000	Barclays 4,918% 8/8/2030	1.945.674	0,03	GBP 1.143.000	Dowson 2022-1 7,445% 20/1/2029	1.440.593	0,02
EUR 7.000.000	Barclays 5,262% 29/1/2034	7.592.984	0,10	GBP 725.000	Dowson 2022-1 7,895% 20/1/2029	902.837	0,01
USD 500.000	Barclays 6,125% 15/12/2025	444.316	0,01	GBP 451.000	Dowson 2022-2 8,895% 20/8/2029	576.418	0,01
GBP 600.000	Barclays 6,375% 15/12/2025	675.974	0,01	GBP 245.000	Dowson 2022-2 10,445% 20/8/2029	310.520	0,01
GBP 400.000	Barclays 7,125% 15/6/2025	468.237	0,01	EUR 2.820.000	DS Smith 4,5% 27/7/2030	3.040.760	0,04
USD 861.000	Barclays 8% 15/6/2024	844.654	0,01	EUR 3.498.000	EC Finance 3% 15/10/2026	3.570.979	0,05
GBP 520.000	Barley Hill NO 2 6,895% 27/8/2058	633.698	0,01	GBP 364.219	Finsbury Square 5,647% 16/12/2067	459.050	0,01
EUR 700.000	BAT International Finance 2,75% 25/3/2025*	744.818	0,01	GBP 544.000	Finsbury Square 5,997% 16/12/2067	678.896	0,01
EUR 700.000	BCP V Modular Services Finance II 4,75% 30/11/2028*	642.049	0,01	GBP 1.045.000	Finsbury Square 6,247% 16/12/2067	1.281.852	0,02
GBP 400.000	BCP V Modular Services Finance II 6,125% 30/11/2028	416.060	0,01	GBP 862.088	Finsbury Square 2021-2 5,797% 16/12/2071	1.088.033	0,02
GBP 2.985.000	Bellis Acquisition 3,25% 16/2/2026	3.253.238	0,04	GBP 435.000	Finsbury Square 2021-2 6,247% 16/12/2071	545.068	0,01
GBP 3.498.000	Bellis Acquisition 4,5% 16/2/2026	3.894.327	0,05	GBP 371.000	Finsbury Square 2021-2 6,397% 16/12/2071	454.684	0,01
GBP 1.826.000	BG Energy Capital 5,125% 1/12/2025	2.287.034	0,03	GBP 201.000	Finsbury Square 2021-2 6,697% 16/12/2071	240.013	0,00
EUR 9.176.000	BP Capital Markets 3,25% 22/3/2026	9.321.743	0,13	GBP 116.000	Funding V 6,895% 15/10/2025	146.827	0,00
EUR 1.658.000	BP Capital Markets 3,625% 22/3/2029	1.585.675	0,02	GBP 3.104.000	Funding VI 6,595% 15/7/2026	3.941.252	0,06
GBP 607.000	Brants Bridge 2023-1 5,952% 14/6/2066	767.486	0,01	GBP 736.000	Funding VI 8,295% 15/7/2026	938.775	0,01
EUR 8.375.000	British Telecommunications 1,874% 18/8/2080*	8.312.254	0,12	GBP 1.236.000	Funding VIII 6,375% 15/5/2028	1.567.546	0,02
USD 1.000.000	British Telecommunications 4,25% 23/11/2081	882.991	0,01	GBP 229.000	Funding VIII 7,695% 15/5/2028	290.930	0,00
USD 1.300.000	British Telecommunications 4,875% 23/11/2081	1.067.325	0,01	GBP 145.000	Funding VIII 8,695% 15/5/2028	184.260	0,00
GBP 3.200.000	British Telecommunications 5,75% 7/12/2028	4.015.979	0,06	GBP 218.000	Gemgarto 2021-1 6,297% 16/12/2067	271.313	0,00
				GBP 1.880.000	Great Hall Mortgages No 1 5,439% 18/6/2039	2.284.261	0,03
				GBP 2.454.784	Greene King Finance 3,593% 15/3/2035	2.587.108	0,04

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
GBP 981.897	Greene King Finance 4,064% 15/3/2035	1.050.114	0,02	USD 626.000	Liquid Telecommunications Financing 5,5% 4/9/2026	391.720	0,01
GBP 300.000	Greene King Finance 6,903% 15/12/2034	302.772	0,00	GBP 981.000	Lloyds Banking 1,875% 15/1/2026	1.170.449	0,02
GBP 300.000	Greene King Finance 7,08% 15/3/2036	300.326	0,00	GBP 1.800.000	Lloyds Banking 2% 12/4/2028	1.945.629	0,03
GBP 741.000	Harben Finance 6,242% 28/9/2055	896.354	0,01	GBP 2.000.000	Lloyds Banking 2,25% 16/10/2024	2.429.545	0,03
GBP 441.000	Harben Finance 6,592% 28/9/2055	515.261	0,01	EUR 900.000	Lloyds Banking 4,947% 27/6/2025	915.159	0,01
GBP 400.000	Heathrow Finance 3,875% 1/3/2027*	437.648	0,01	USD 800.000	Lloyds Banking 7,5% 27/6/2024*	780.829	0,01
GBP 405.000	Heathrow Finance 4,125% 1/9/2029	415.727	0,01	GBP 299.000	London Cards NO 1 8,945% 15/5/2033	377.913	0,01
GBP 1.099.000	Heathrow Finance 4,75% 1/3/2024	1.368.934	0,02	GBP 383.088	London Wall Mortgage Capital 5,968% 15/5/2051	482.414	0,01
GBP 518.000	Heathrow Finance 5,75% 3/3/2025*	638.641	0,01	GBP 219.284	London Wall Mortgage Capital 6,018% 15/5/2052	276.203	0,00
GBP 183.000	Hermitage 2023 7,646% 21/9/2033	232.200	0,00	GBP 1.483.000	Mitchells & Butlers Finance 7,347% 15/6/2036	1.524.699	0,02
GBP 199.992	Hops Hill No 1 7,045% 27/5/2054	252.899	0,00	GBP 550.000	Mobico 4,25% 26/11/2025	608.558	0,01
GBP 99.997	Hops Hill No 1 7,545% 27/5/2054	124.930	0,00	GBP 614.702	Mortimer BTL 2021-1 5,733% 23/6/2053	771.374	0,01
GBP 1.391.000	Hops Hill No 3 0% 21/12/2055	1.757.569	0,02	GBP 198.000	Mortimer BTL 2021-1 6,133% 23/6/2053	246.495	0,00
GBP 1.127.000	Hops Hill No 3 6,532% 21/12/2055	1.410.398	0,02	GBP 111.000	Mortimer BTL 2021-1 6,483% 23/6/2053	135.843	0,00
GBP 1.041.000	Hops Hill No 3 7,332% 21/12/2055	1.293.858	0,02	EUR 3.200.000	National Grid 3,245% 30/3/2034	3.120.360	0,04
GBP 1.000.000	Hops Hill No2 7,445% 27/11/2054	1.277.891	0,02	GBP 695.000	National Grid Electricity Distribution South West 5,875% 25/3/2027	882.368	0,01
GBP 264.000	Hops Hill No2 8,045% 27/11/2054	333.723	0,01	GBP 900.000	National Grid Electricity Transmission 5,875% 2/2/2024	1.139.972	0,02
GBP 8.060.000	HSBC 1,75% 24/7/2027	8.983.431	0,12	GBP 1.400.000	Nationwide Building Society 5,75% 20/6/2027*	1.527.644	0,02
GBP 2.200.000	HSBC 2,256% 13/11/2026	2.550.150	0,04	GBP 3.170.000	NatWest 2,875% 19/9/2026	3.715.584	0,05
GBP 1.300.000	Imperial Brands Finance 5,5% 28/9/2026	1.608.271	0,02	GBP 1.000.000	NatWest 3,125% 28/3/2027	1.161.416	0,02
GBP 700.000	Imperial Brands Finance 8,125% 15/3/2024	895.523	0,01	GBP 1.700.000	NatWest Markets 6,375% 8/11/2027	2.159.811	0,03
EUR 1.400.000	INEOS Finance 6,625% 15/5/2028*	1.511.276	0,02	USD 8.097.000	Neptune Energy Bondco 6,625% 15/5/2025	8.063.802	0,11
EUR 2.414.000	INEOS Quattro Finance 2 2,5% 15/1/2026	2.388.515	0,03	GBP 775.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6,745% 15/3/2029	979.600	0,01
EUR 5.470.000	Informa 2,125% 6/10/2025	5.687.561	0,08	GBP 595.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6,095% 15/11/2029	750.367	0,01
GBP 3.834.000	Informa 3,125% 5/7/2026	4.481.302	0,06	GBP 677.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6,545% 15/11/2029	848.394	0,01
USD 200.000	International Game Technology 6,25% 15/1/2027	198.279	0,00	GBP 1.212.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-2 10,195% 15/7/2030	1.553.348	0,02
GBP 1.582.000	Iron Mountain UK 3,875% 15/11/2025	1.890.431	0,03	EUR 572.620	Newgate Funding 3,754% 1/12/2050	577.642	0,01
EUR 990.000	Jaguar Land Rover Automotive 4,5% 15/7/2028*	969.328	0,01	EUR 11.000.000	NGG Finance 1,625% 5/12/2079	11.380.749	0,16
EUR 300.000	Jaguar Land Rover Automotive 6,875% 15/11/2026	329.562	0,01	GBP 1.000.000	NIE Finance 2,5% 27/10/2025	1.176.056	0,02
GBP 776.000	Jerrold Finco 4,875% 15/1/2026	880.290	0,01	EUR 233.696	Paragon Mortgages No 12 4,261% 15/11/2038	237.916	0,00
GBP 370.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7,208% 12/6/2057	465.855	0,01	GBP 2.200.862	Parkmore Point RMBS 2022-1 6,673% 25/7/2045	2.766.317	0,04
GBP 260.363	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 5,809% 20/7/2058	326.623	0,00	GBP 509.477	Pierpont BTL 2021-1 5,833% 22/12/2053	640.801	0,01
GBP 173.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,109% 20/7/2058	213.777	0,00	GBP 802.000	Pierpont BTL 2021-1 6,283% 22/12/2053	993.415	0,01
GBP 158.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,409% 20/7/2058	192.437	0,00	GBP 873.000	Pierpont Btl 2023-1 5,935% 21/9/2054	1.106.537	0,02
GBP 102.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,809% 20/7/2058	122.079	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
GBP 458.000	Pierpont Btl 2023-1 6,735% 21/9/2054	579.476	0,01	GBP 2.010.543	Tesco Property Finance 3 5,744% 13/4/2040	2.371.669	0,03
GBP 5.218.000	Pinewood Finance 3,25% 30/9/2025	6.146.648	0,09	GBP 917.728	Tesco Property Finance 4 5,801% 13/10/2040	1.089.109	0,01
GBP 421.000	Polaris 2022-1 6,697% 23/10/2059	517.259	0,01	GBP 1.042.000	Thames Water Kemble Finance 4,625% 19/5/2026	894.904	0,01
GBP 307.000	Polaris 2022-1 7,197% 23/10/2059	375.055	0,01	EUR 337.000	Thames Water Utilities Finance 0,875% 31/1/2028	306.560	0,00
GBP 538.000	Polaris 2022-1 8,597% 23/10/2059	652.604	0,01	GBP 1.783.000	Thames Water Utilities Finance 4% 19/6/2025	2.114.538	0,03
GBP 1.244.888	Polaris 2023-1 6,447% 23/2/2061	1.583.007	0,02	EUR 5.038.000	Thames Water Utilities Finance 4,375% 18/1/2031	5.148.816	0,07
GBP 488.000	Polaris 2023-1 7,947% 23/2/2061	623.556	0,01	GBP 263.312	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 5,837% 12/7/2063	331.832	0,01
GBP 361.000	Polaris 2023-1 8,847% 23/2/2061	460.013	0,01	GBP 157.000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6,087% 12/7/2063	194.845	0,00
GBP 223.000	Polaris 2023-1 9,547% 23/2/2061	281.923	0,00	GBP 107.000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6,387% 12/7/2063	130.948	0,00
GBP 115.000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6,646% 16/10/2056	145.340	0,00	GBP 364.999	Tower Bridge Funding 2021-1 7,014% 21/7/2064	460.776	0,01
GBP 100.000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 7,146% 16/10/2056	124.375	0,00	GBP 252.000	Tower Bridge Funding 2021-1 7,314% 21/7/2064	316.496	0,00
GBP 1.735.000	Premier Foods Finance 3,5% 15/10/2026	1.989.937	0,03	GBP 986.066	Tower Bridge Funding 2022-1 5,745% 20/12/2063	1.238.519	0,02
GBP 1.197.000	Residential Mortgage 32 7,225% 20/6/2070	1.512.143	0,02	GBP 264.000	Tower Bridge Funding 2022-1 6,275% 20/12/2063	322.383	0,00
EUR 39.154	RMAC No 1 3,736% 12/6/2044	40.199	0,00	GBP 312.000	Tower Bridge Funding 2023-1 7,359% 20/10/2064	396.001	0,01
EUR 557.315	RMAC No 1 3,756% 12/6/2044	569.973	0,01	GBP 211.000	Tower Bridge Funding 2023-1 8,309% 20/10/2064	268.500	0,00
GBP 292.382	RMAC No 1 5,228% 12/6/2044	356.832	0,01	GBP 237.000	Tower Bridge Funding 2023-1 9,459% 20/10/2064	299.859	0,00
EUR 400.000	Rolls-Royce 1,625% 9/5/2028	374.139	0,00	GBP 158.000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	201.341	0,00
EUR 442.000	Rolls-Royce 4,625% 16/2/2026*	475.877	0,01	GBP 234.000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	297.542	0,00
USD 200.000	Rolls-Royce 5,75% 15/10/2027	194.497	0,00	GBP 201.000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	255.487	0,00
GBP 176.000	Rolls-Royce 5,75% 15/10/2027	211.398	0,00	GBP 1.590.000	Turbo Finance 9 6,845% 20/8/2028	2.021.993	0,03
USD 1.725.000	Royalty Pharma 2,2% 2/9/2030	1.376.952	0,02	GBP 797.000	Twin Bridges 5,721% 14/6/2055	1.009.535	0,01
GBP 535.000	Sage AR Funding No 1 7,369% 17/11/2030	640.061	0,01	GBP 1.259.000	Twin Bridges 6,371% 14/6/2055	1.582.092	0,02
GBP 1.000.000	Santander UK 3,625% 14/1/2026	1.181.129	0,02	GBP 529.000	Twin Bridges 7,271% 14/6/2055	663.204	0,01
GBP 799.000	Santander UK 6,75% 24/6/2024	981.672	0,01	GBP 340.000	Twin Bridges 8,271% 14/6/2055	430.799	0,01
GBP 369.000	Satus 2021-1 6,396% 17/8/2028	468.488	0,01	GBP 500.000	Twin Bridges 2020-1 6,958% 12/12/2054	636.133	0,01
GBP 453.000	Satus 2021-1 6,796% 17/8/2028	571.977	0,01	GBP 390.000	Twin Bridges 2020-1 7,208% 12/12/2054	494.532	0,01
GBP 122.000	Satus 2021-1 7,096% 17/8/2028	151.661	0,00	GBP 225.000	Twin Bridges 2020-1 7,958% 12/12/2054	284.437	0,00
GBP 247.000	Satus 2021-1 8,396% 17/8/2028	309.984	0,01	GBP 436.000	Twin Bridges 2021-1 6,558% 12/3/2055	540.971	0,01
USD 3.609.950	SCC Power 4% 17/5/2032	388.070	0,00	GBP 220.000	Twin Bridges 2021-1 7,058% 12/3/2055	270.622	0,00
USD 6.664.525	SCC Power 8% 31/12/2028	2.482.536	0,04	GBP 596.719	Twin Bridges 2021-2 5,618% 12/9/2055	748.418	0,01
GBP 324.000	Sherwood Financing 6% 15/11/2026	339.477	0,00	GBP 274.000	Twin Bridges 2021-2 5,858% 12/9/2055	338.509	0,01
GBP 900.000	SP Distribution 5,875% 17/7/2026	1.140.136	0,02	GBP 435.000	Twin Bridges 2021-2 6,108% 12/9/2055	528.488	0,01
GBP 2.300.000	SSE 8,375% 20/11/2028	3.234.757	0,04	GBP 187.000	Twin Bridges 2021-2 6,458% 12/9/2055	222.508	0,00
EUR 1.702.000	Standard Chartered 4,874% 10/5/2031	1.842.422	0,03				
GBP 535.000	Stanlington No 2 6,708% 12/6/2045	664.580	0,01				
GBP 329.000	Stanlington No 2 7,158% 12/6/2045	402.362	0,01				
GBP 450.000	Stanlington No 2 8% 12/6/2045	543.314	0,01				
GBP 2.930.000	Stonegate Pub Financing 2019 8% 13/7/2025	3.423.169	0,05				
GBP 540.000	Stonegate Pub Financing 2019 8,25% 31/7/2025	633.157	0,01				
EUR 1.478.000	Synthomer 3,875% 1/7/2025*	1.484.926	0,02				
GBP 819.491	Tesco Property Finance 1 7,623% 13/7/2039	1.109.906	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
GBP 830.000	Twin Bridges 2022-1 6,258% 1/12/2055	997.648	0,01	USD 1.228.685	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 0% 15/8/2030	1.134.341	0,01
GBP 365.000	Twin Bridges 2022-1 6,658% 1/12/2055	429.772	0,01	USD 1.297.000	Affinity Interactive 6,875% 15/12/2027	1.151.423	0,02
GBP 2.791.000	Twin Bridges 2022-2 6,958% 12/6/2055	3.542.608	0,05	USD 340.000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-1 3,659% 25/1/2045	182.687	0,00
GBP 1.588.312	Unique Pub Finance 5,659% 30/6/2027	1.988.435	0,03	USD 391.000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-3 3,537% 25/4/2045	209.160	0,00
GBP 1.097.000	Unique Pub Finance 6,464% 30/3/2032	1.350.333	0,02	USD 273.000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-4 3,513% 25/6/2045	124.413	0,00
GBP 266.861	Unique Pub Finance 7,395% 28/3/2024	336.444	0,00	USD 35.786	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 0% 25/12/2057	17.771	0,00
GBP 42.007.573	United Kingdom Gilt 0,5% 22/10/2061	15.746.025	0,22	USD 603.745	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-C 2,25% 27/9/2060	593.731	0,01
USD 1.316.000	Vedanta Resources 6,125% 9/8/2024	788.968	0,01	USD 3.756.695	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-D 2,25% 25/6/2060	3.666.685	0,05
USD 3.887.000	Vedanta Resources Finance II 8,95% 11/3/2025	2.549.678	0,04	USD 13.526.556	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-C 2,115% 25/1/2061	12.884.241	0,18
GBP 800.000	Virgin Media Secured Finance 4,25% 15/1/2030	809.734	0,01	USD 26.940.001	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-F 1,875% 25/6/2061	25.161.875	0,35
GBP 100.000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	115.800	0,00	USD 1.678.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,5% 15/3/2029	1.455.092	0,02
GBP 400.000	Virgin Media Secured Finance 5,25% 15/5/2029	431.954	0,01	USD 176.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,625% 15/1/2027	166.640	0,00
EUR 4.484.000	Vmed O2 UK Financing I 3,25% 31/1/2031	4.057.030	0,06	USD 130.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,875% 15/2/2030	119.433	0,00
GBP 338.000	Vmed O2 UK Financing I 4% 31/1/2029	343.527	0,00	USD 1.775.000	Alexander Funding Trust II 7,467% 31/7/2028	1.794.472	0,02
GBP 1.338.000	Vmed O2 UK Financing I 4,5% 15/7/2031	1.318.255	0,02	USD 1.327.000	Alexandria Real Estate Equities 2,95% 15/3/2034	1.050.783	0,01
EUR 975.000	Vodafone 2,625% 27/8/2080	966.743	0,01	USD 900.000	Alexandria Real Estate Equities 4,5% 30/7/2029	853.564	0,01
EUR 950.000	Vodafone 3% 27/8/2080	846.925	0,01	USD 403.000	Alexandria Real Estate Equities 4,75% 15/4/2035	373.812	0,01
EUR 600.000	Vodafone 4,2% 3/10/2078	602.958	0,01	USD 1.043.000	Allegiant Travel 7,25% 15/8/2027	1.021.937	0,01
GBP 3.100.000	Vodafone 4,875% 3/10/2078	3.703.953	0,05	USD 9.893.000	Allegiant Travel 8,5% 5/2/2024	9.914.962	0,14
USD 1.626.000	Vodafone 6,25% 3/10/2078*	1.603.642	0,02	USD 3.441.664	Alternative Loan Trust 2004-22CB 6,25% 25/10/2034	3.411.206	0,05
		335.938.762	4,67	USD 2.026.758	Alternative Loan Trust 2005-22T1 5,42% 25/6/2035	1.659.677	0,02
				USD 513.097	Alternative Loan Trust 2005-76 5,43% 25/2/2036	466.272	0,01
	États-Unis			USD 2.447.154	Alternative Loan Trust 2005-J4 7,454% 25/7/2035	2.358.210	0,03
USD 460.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	405.795	0,01	USD 3.454.993	Alternative Loan Trust 2006-11CB 6,5% 25/5/2036	1.779.183	0,03
USD 1.500.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	1.264.358	0,02	USD 938.769	Alternative Loan Trust 2006-15CB 6,5% 25/6/2036	465.081	0,01
USD 300.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	271.784	0,00	USD 1.519.476	Alternative Loan Trust 2006-23CB 5,829% 25/8/2036	315.434	0,00
USD 7.000.000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 0,271% 5/6/2037	43.932	0,00	USD 2.776.479	Alternative Loan Trust 2006-J7 6,25% 25/11/2036	1.447.392	0,02
USD 320.000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3,779% 5/6/2037	251.134	0,00	USD 529.489	Alternative Loan Trust 2006-J7 6,933% 20/11/2046	396.051	0,01
USD 1.708.000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3,779% 5/6/2037	1.324.256	0,02	USD 373.663	Alternative Loan Trust 2006-OA11 5,809% 25/9/2046	323.283	0,00
USD 1.070.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 6,902% 15/9/2034	965.989	0,01	USD 2.722.225	Alternative Loan Trust 2006-OA14 6,16% 25/11/2046	2.115.131	0,03
USD 4.110.133	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 7,485% 15/9/2034	3.649.218	0,05	USD 2.930.012	Alternative Loan Trust 2006-OA16 6,109% 25/10/2046	2.116.231	0,03
USD 1.045.000	AbbVie 2,6% 21/11/2024	1.007.656	0,01	USD 304.863	Alternative Loan Trust 2006-OA8 5,809% 25/7/2046	260.915	0,00
USD 1.500.000	AbbVie 2,95% 21/11/2026	1.402.877	0,02	USD 2.443.563	Alternative Loan Trust 2006-OC10 5,889% 25/11/2036	2.113.098	0,03
USD 365.000	AbbVie 3,2% 14/5/2026	346.665	0,01	USD 2.669.523	Alternative Loan Trust 2006-OC7 5,929% 25/7/2046	2.386.477	0,03
USD 8.885.000	AbbVie 3,2% 21/11/2029	8.007.503	0,11				
USD 603.502	AccessLex Institute 5,953% 25/5/2036	586.721	0,01				
USD 2.041.892	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 5,689% 25/5/2037	360.677	0,01				
USD 103.678	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 6,029% 25/5/2037	18.439	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 3.179.102	Alternative Loan Trust 2007-25 6,5% 25/11/2037	1.542.584	0,02	USD 3.000.000	American Tower 5,65% 15/3/2033	2.988.539	0,04
USD 4.495.228	Alternative Loan Trust 2007-3T1 6% 25/4/2037	2.154.565	0,03	USD 1.346.000	American University/The 3,672% 1/4/2049	1.048.686	0,01
USD 2.644.358	Alternative Loan Trust 2007-9T1 6% 25/5/2037	1.364.151	0,02	USD 1.648.000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9,375% 1/6/2028	1.685.430	0,02
USD 2.567	Alternative Loan Trust 2007-OA3 5,789% 25/4/2047	257	0,00	USD 2.000.000	Amgen 1,65% 15/8/2028	1.705.148	0,02
USD 172.836	Alternative Loan Trust 2007-OA8 5,789% 25/6/2047	129.943	0,00	USD 750.000	Amgen 2% 15/1/2032	588.711	0,01
USD 189.689	Alternative Loan Trust 2007-OH2 5,909% 25/8/2047	165.741	0,00	USD 3.250.000	Amgen 2,3% 25/2/2031	2.684.468	0,04
USD 4.345.000	Amazon.com 2,1% 12/5/2031	3.606.817	0,05	USD 1.320.000	Amgen 2,45% 21/2/2030	1.123.235	0,02
USD 4.690.000	Amazon.com 4,7% 1/12/2032	4.663.688	0,06	USD 1.000.000	Amgen 3% 22/2/2029	903.389	0,01
USD 671.974	Ambac Assurance 5,1% 31/12/9999	977.775	0,01	USD 6.315.000	Amgen 4,05% 18/8/2029	5.961.049	0,08
USD 1.251.000	American Express 2,5% 30/7/2024	1.215.222	0,02	USD 5.200.000	Amgen 5,15% 2/3/2028	5.190.954	0,07
USD 2.500.000	American Express 3% 30/10/2024	2.426.034	0,03	GBP 7.681.000	Amgen 5,5% 7/12/2026	9.687.889	0,13
USD 750.000	American Express 4,05% 3/5/2029	711.420	0,01	USD 1.375.000	Amkor Technology 6,625% 15/9/2027	1.376.332	0,02
USD 2.090.000	American Express 4,9% 13/2/2026	2.063.042	0,03	USD 700.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 3,5% 1/6/2030	643.987	0,01
USD 2.440.000	American Express 4,99% 1/5/2026	2.404.574	0,03	USD 7.322.956	APS Resecuritization Trust 2016-1 2,978% 31/7/2057	2.481.984	0,03
USD 732.782	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 5,37% 25/10/2046	504.191	0,01	USD 607.248	APS Resecuritization Trust 2016-3 8,279% 27/9/2046	609.401	0,01
USD 1.553.783	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 5,639% 25/10/2046	842.445	0,01	EUR 1.260.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028	1.135.463	0,02
USD 559.672	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 5,13% 25/2/2047	223.439	0,00	EUR 641.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029*	522.926	0,01
USD 3.907.883	American Home Mortgage Investment Trust 2007-1 5,619% 25/5/2047	2.289.879	0,03	USD 3.103.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3,25% 1/9/2028	2.638.241	0,04
USD 1.876.000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust 6,231% 17/10/2036	1.858.548	0,03	USD 10.110.000	AREIT 2022-CRE7 7,556% 17/6/2039	10.113.975	0,14
USD 4.687.372	American Homes 4 Rent 2015-SFR1 Trust 0% 17/4/2052	47	0,00	USD 2.973.097	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 5,909% 25/5/2035	2.601.588	0,04
USD 1.285.000	American Municipal Power 7,834% 15/2/2041	1.580.059	0,02	USD 155.000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	158.095	0,00
EUR 2.750.000	American Tower 0,4% 15/2/2027	2.612.425	0,04	USD 2.200.000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 7,583% 15/4/2035	2.115.776	0,03
EUR 1.050.000	American Tower 0,45% 15/1/2027	1.001.270	0,01	USD 3.265.000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 8,583% 15/4/2035	3.175.736	0,04
EUR 1.600.000	American Tower 0,5% 15/1/2028	1.478.998	0,02	USD 578.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	498.438	0,01
USD 2.000.000	American Tower 1,5% 31/1/2028	1.679.499	0,02	USD 1.520.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/4/2030	1.297.343	0,02
EUR 2.100.000	American Tower 1,95% 22/5/2026*	2.145.334	0,03	USD 3.604.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6,625% 15/1/2028	3.454.811	0,05
USD 750.000	American Tower 2,1% 15/6/2030	598.770	0,01	USD 2.085.000	Astrazeneca Finance 4,875% 3/3/2028	2.078.111	0,03
USD 4.000.000	American Tower 2,3% 15/9/2031	3.132.127	0,04	USD 1.500.000	Astrazeneca Finance 4,9% 3/3/2030	1.491.681	0,02
USD 2.540.000	American Tower 2,7% 15/4/2031	2.077.962	0,03	EUR 9.800.000	AT&T 2,875% 2/3/2025*	9.897.760	0,14
USD 1.000.000	American Tower 2,75% 15/1/2027	913.943	0,01	GBP 9.000.000	AT&T 2,9% 4/12/2026	10.333.867	0,14
USD 1.300.000	American Tower 2,95% 15/1/2025	1.249.682	0,02	EUR 1.700.000	AT&T 3,15% 4/9/2036	1.604.593	0,02
EUR 3.050.000	American Tower 4,125% 16/5/2027*	3.292.240	0,05	EUR 1.810.000	AT&T 4,3% 18/11/2034	1.924.751	0,03
USD 1.684.000	American Tower 5,25% 15/7/2028	1.657.644	0,02	GBP 4.000.000	AT&T 5,5% 15/3/2027	4.943.865	0,07
				USD 3.538.972	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 7,558% 15/12/2036	3.227.153	0,05
				USD 300.000	AvalonBay Communities 3,35% 15/5/2027	280.539	0,00
				USD 699.000	AvalonBay Communities 5% 15/2/2033	692.953	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 1.100.000	Avantor Funding 2,625% 1/11/2025	1.136.901	0,02	USD 1.881.000	Bank of America 3,705% 24/4/2028	1.759.879	0,02
USD 1.282.000	Azul Investments 5,875% 26/10/2024	1.179.440	0,02	USD 775.000	Bank of America 3,824% 20/1/2028	730.092	0,01
USD 2.871.000	Azul Investments 5,875% 26/10/2024	2.641.320	0,04	USD 1.020.000	Bank of America 3,97% 5/3/2029	952.343	0,01
USD 1.187.000	Azul Secured Finance 11,93% 28/8/2028	1.182.080	0,02	USD 1.020.000	Bank of America 3,974% 7/2/2030	940.349	0,01
USD 1.607.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3,716% 14/4/2033	1.375.004	0,02	USD 3.742.000	Bank of America 4,376% 27/4/2028	3.590.062	0,05
USD 5.860.000	Bamll Commercial Mortgage Trust 2016-SS1 0,702% 15/12/2035	60.305	0,00	USD 4.720.000	Bank of America 4,827% 22/7/2026	4.631.970	0,06
USD 100.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,358% 15/11/2033	94.280	0,00	USD 7.094.000	Bank of America 5,202% 25/4/2029	6.986.988	0,10
USD 3.273.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,758% 15/11/2033	3.010.851	0,04	USD 9.780.000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 0,735% 15/2/2050	177.759	0,00
USD 3.645.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,858% 15/11/2032	3.060.250	0,04	USD 4.000.000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 1,391% 15/2/2050	147.104	0,00
USD 1.780.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 7,358% 15/11/2032	1.466.889	0,02	USD 1.700.000	Bank of New York Mellon 2,05% 26/1/2027	1.536.358	0,02
USD 454.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 6,508% 15/9/2034	451.929	0,01	USD 5.750.000	Bank of New York Mellon 3,85% 26/4/2029	5.434.010	0,08
USD 160.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 6,708% 15/9/2034	158.898	0,00	USD 1.475.000	Bank of New York Mellon 4,947% 26/4/2027	1.451.335	0,02
USD 3.215.409	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 7,058% 15/9/2034	3.185.623	0,04	USD 1.500.000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7,07% 10/2/2022***	376.317	0,01
USD 939.000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2015-UBS7 4,482% 15/9/2048	843.396	0,01	USD 2.380.000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7,324% 10/12/2025	451.198	0,01
USD 209.483	Banc of America Funding 2006- A Trust 4,388% 20/2/2036	188.155	0,00	USD 1.725.000	Bay Area Toll Authority 6,918% 1/4/2040	1.967.754	0,03
USD 12.895.473	Banc of America Funding 2014- R2 Trust 0% 26/11/2036	3.827.576	0,05	USD 902.300	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 5,749% 25/11/2035	819.622	0,01
EUR 150.000	Banff Merger Sub 8,375% 1/9/2026	159.048	0,00	USD 1.533.776	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 5,879% 25/1/2036	1.407.949	0,02
EUR 2.810.000	Bank of America 0,583% 24/8/2028	2.649.439	0,04	USD 37.247	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 6,014% 25/1/2036	34.241	0,00
EUR 3.800.000	Bank of America 1,381% 9/5/2030	3.533.340	0,05	USD 98.438	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 6,104% 25/1/2036	90.234	0,00
USD 341.000	Bank of America 1,658% 11/3/2027	308.090	0,00	USD 140.232	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5,969% 25/4/2036	132.691	0,00
USD 750.000	Bank of America 1,922% 24/10/2031	587.858	0,01	USD 403.166	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 6,029% 25/4/2036	360.174	0,01
EUR 4.200.000	Bank of America 1,949% 27/10/2026	4.340.659	0,06	USD 97.014	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 6,059% 25/4/2036	86.412	0,00
USD 2.415.000	Bank of America 2,299% 21/7/2032	1.906.215	0,03	USD 530.291	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 6,209% 25/4/2036	473.694	0,01
USD 5.000.000	Bank of America 2,496% 13/2/2031	4.159.105	0,06	USD 263.172	Bayview Commercial Asset Trust 2006-2 5,849% 25/7/2036	238.887	0,00
USD 2.355.000	Bank of America 2,572% 20/10/2032	1.887.409	0,03	USD 438.887	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5,679% 25/10/2036	405.639	0,01
USD 750.000	Bank of America 2,592% 29/4/2031	624.380	0,01	USD 2.426.140	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 5,774% 25/12/2036	2.241.592	0,03
USD 2.415.000	Bank of America 2,651% 11/3/2032	1.978.230	0,03				
USD 1.500.000	Bank of America 2,687% 22/4/2032	1.227.809	0,02				
USD 4.009.000	Bank of America 3,384% 2/4/2026	3.851.951	0,05				
USD 361.000	Bank of America 3,5% 19/4/2026	343.276	0,00				

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.828.365	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 5,834% 25/3/2037	1.645.356	0,02	USD 1.479.890	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE7 5,769% 25/9/2036	1.455.012	0,02
USD 2.665.316	Bayview Commercial Asset Trust 2007-2 5,699% 25/7/2037	2.365.412	0,03	USD 720.000	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE8 5,949% 25/10/2036	624.503	0,01
USD 4.132.263	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 6,104% 25/9/2037	3.785.008	0,05	USD 429.625	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 5,569% 25/3/2037	386.756	0,01
USD 1.545.938	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 6,929% 25/12/2037	1.313.931	0,02	USD 676.909	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 5,569% 25/3/2037	612.130	0,01
USD 1.630.545	Bayview Commercial Asset Trust 2008-2 7,929% 25/4/2038	1.591.385	0,02	USD 932.242	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 5,749% 25/3/2037	829.092	0,01
USD 4.757.019	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 6,435% 28/5/2039	3.836.488	0,05	USD 339.745	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 5,679% 25/4/2037	485.892	0,01
USD 1.213.914	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 6,735% 28/5/2039	1.033.635	0,01	USD 5.208.551	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 5,779% 25/4/2037	5.243.821	0,07
USD 3.937.681	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 6,435% 28/2/2040	3.450.341	0,05	USD 203.910	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 5,709% 25/8/2036	197.514	0,00
USD 314.363	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E 6,435% 28/12/2040	293.454	0,00	USD 239.511	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 5,769% 25/3/2037	219.259	0,00
USD 840.000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 4,409% 5/8/2038	552.373	0,01	USD 435.931	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 5,569% 25/3/2037	372.112	0,01
USD 877.000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6,23% 15/3/2037	806.995	0,01	USD 290.095	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 5,639% 25/6/2037	271.426	0,00
USD 1.000.000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6,479% 15/3/2037	846.184	0,01	USD 3.142.000	Beazer Homes USA 7,25% 15/10/2029	3.033.652	0,04
USD 11.710.000	BBCMS Trust 2015-SRCH 0,295% 10/8/2035	88.039	0,00	EUR 1.000.000	Becton Dickinson 0,034% 13/8/2025	1.007.133	0,01
USD 19.046.126	BBCMS Trust 2015-SRCH 1,059% 10/8/2035	511.371	0,01	USD 2.875.000	Becton Dickinson 1,957% 11/2/2031	2.311.218	0,03
USD 1.035.022	BCAP 2011-RR5-I Trust 4,137% 28/5/2036	984.123	0,01	USD 1.400.000	Becton Dickinson 3,734% 15/12/2024	1.366.065	0,02
USD 1.816.171	BCAP Trust 2007-AA4 4,244% 25/6/2047	829.023	0,01	USD 1.300.000	Becton Dickinson 4,693% 13/2/2028	1.275.687	0,02
USD 1.627.547	BCMSC Trust 2000-A 7,575% 15/6/2030	209.701	0,00	EUR 500.000	Belden 3,375% 15/7/2027*	506.941	0,01
USD 1.510.989	BCMSC Trust 2000-A 7,83% 15/6/2030	201.259	0,00	EUR 200.000	Belden 3,875% 15/3/2028*	200.828	0,00
USD 1.089.739	BCMSC Trust 2000-A 8,29% 15/6/2030	153.706	0,00	USD 2.000.000	Belton Independent School District 4% 15/2/2047	1.874.064	0,03
USD 5.980.000	BDS 2022-FL12 7,45% 19/8/2038	5.971.334	0,08	USD 5.012.995	BHMS 2018-ATLS 6,857% 15/7/2035	4.927.138	0,07
USD 408.253	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 5,749% 25/11/2036	333.156	0,00	USD 4.161.000	BHMS 2018-ATLS 7,507% 15/7/2035	3.998.996	0,06
USD 1.716.867	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 5,749% 25/1/2047	1.408.425	0,02	USD 1.321.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	1.315.247	0,02
USD 49.145	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 3,682% 25/7/2034	44.392	0,00	USD 464.000	Blue Racer Midstream / Blue Racer Finance 7,625% 15/12/2025	465.124	0,01
USD 23.721	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2004-HE7 7,154% 25/8/2034	23.409	0,00	EUR 1.100.000	Booking 4% 15/11/2026*	1.205.468	0,02
USD 1.709.237	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-AC9 6,25% 25/12/2035	1.083.040	0,02	EUR 5.244.000	Boxer Parent 6,5% 2/10/2025	5.653.040	0,08
USD 1.840.023	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-HE8 7,379% 25/8/2035	1.813.573	0,03	USD 1.045.000	BP Capital Markets America 3,588% 14/4/2027	996.296	0,01
USD 2.176.281	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-AC1 6,25% 25/2/2036	1.585.944	0,02	USD 1.460.000	BP Capital Markets America 3,937% 21/9/2028	1.392.973	0,02
USD 1.351.133	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE1 5,02% 25/12/2035	1.992.230	0,03	USD 5.612.000	Broadcom 2,45% 15/2/2031	4.526.692	0,06
				USD 2.250.000	Broadcom 3,419% 15/4/2033	1.866.949	0,03
				USD 1.410.000	Broadcom 4% 15/4/2029	1.299.587	0,02
				USD 4.210.000	Broadcom 4,15% 15/11/2030	3.850.030	0,05
				USD 1.500.000	Broadcom 4,3% 15/11/2032	1.356.871	0,02
				USD 82.000	Buckeye Partners 3,95% 1/12/2026	75.542	0,00
				USD 941.000	Buckeye Partners 4,125% 1/3/2025	905.430	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.500.000	Buckeye Partners 4,35% 15/10/2024	1.457.520	0,02	USD 1.462.000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2017-C8 4,199% 15/6/2050	1.245.821	0,02
USD 1.034.492	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,454% 10/3/2033	971.307	0,01	USD 1.628.000	Charles Schwab 5,875% 24/8/2026	1.637.325	0,02
USD 2.604.935	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,633% 10/3/2033	2.351.091	0,03	USD 1.825.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2,25% 15/1/2029	1.514.923	0,02
USD 13.358.641	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,717% 10/3/2033	11.762.707	0,16	USD 2.365.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2,3% 1/2/2032	1.785.332	0,03
USD 573.000	BXP Trust 2017-CC 3,67% 13/8/2037	422.014	0,01	USD 1.784.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4,2% 15/3/2028	1.660.683	0,02
USD 2.156.000	BXP Trust 2017-CC 3,67% 13/8/2037	1.493.440	0,02	USD 1.500.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5,05% 30/3/2029	1.425.913	0,02
USD 470.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	392.918	0,01	USD 9.505.824	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 6% 25/12/2037	4.176.842	0,06
USD 945.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	723.856	0,01	EUR 600.000	Chemours 4% 15/5/2026	614.083	0,01
USD 1.864.000	Caesars Entertainment 6,25% 1/7/2025	1.850.724	0,03	USD 874.000	Chesapeake Energy 5,5% 1/2/2026	853.778	0,01
USD 3.368.000	Caesars Entertainment 8,125% 1/7/2027	3.425.990	0,05	USD 2.092.772	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA4 5,39% 25/4/2046	655.473	0,01
USD 1.272.000	California Resources 7,125% 1/2/2026	1.276.066	0,02	USD 323.264	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA5 5,829% 25/4/2046	300.707	0,00
USD 1.655.000	California State Public Works Board 8,361% 1/10/2034	2.016.277	0,03	USD 5.435.709	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 6,5% 25/9/2037	2.090.342	0,03
USD 1.299.000	Calpine 5,125% 15/3/2028	1.187.917	0,02	USD 68.000	Churchill Downs 4,75% 15/1/2028	62.851	0,00
USD 2.755.000	Calumet Specialty Products Partners / Calumet Finance 9,75% 15/7/2028	2.744.966	0,04	USD 82.000	Churchill Downs 5,5% 1/4/2027	79.068	0,00
USD 1.285.000	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 7,575% 15/12/2037	1.269.059	0,02	USD 982.447	Citicorp Mortgage Trust Series 2007-9 6,25% 25/12/2037	817.831	0,01
USD 7.075.000	Capital One Financial 6,377% 8/6/2034	7.005.417	0,10	USD 1.057.180	Citicorp Mortgage Trust Series 2008-2 6,5% 25/6/2038	822.790	0,01
USD 1.490.000	Cargill 4,5% 24/6/2026	1.471.461	0,02	EUR 2.400.000	Citigroup 1,5% 24/7/2026*	2.477.149	0,03
USD 490.000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 6,059% 25/1/2036	390.757	0,01	GBP 1.524.000	Citigroup 1,75% 23/10/2026	1.708.568	0,02
USD 906.848	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC3 5,579% 25/8/2036	852.108	0,01	USD 3.165.000	Citigroup 2,561% 1/5/2032	2.550.350	0,04
USD 302.654	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 5,589% 25/10/2036	290.212	0,00	USD 5.750.000	Citigroup 2,572% 3/6/2031	4.752.348	0,07
USD 2.536.562	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 5,689% 25/2/2037	2.355.872	0,03	USD 3.165.000	Citigroup 2,666% 29/1/2031	2.653.532	0,04
USD 1.198.000	Carrols Restaurant 5,875% 1/7/2029	1.032.077	0,01	USD 6.950.000	Citigroup 3,07% 24/2/2028	6.376.489	0,09
EUR 1.768.000	Catalent Pharma Solutions 2,375% 1/3/2028	1.606.584	0,02	USD 1.933.000	Citigroup 3,29% 17/3/2026	1.856.399	0,03
USD 942.000	CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3,911% 13/11/2050	762.082	0,01	USD 124.000	Citigroup 3,4% 1/5/2026	117.319	0,00
USD 1.270.000	CDI Escrow Issuer 5,75% 1/4/2030	1.186.735	0,02	USD 375.000	Citigroup 3,98% 20/3/2030	344.705	0,00
USD 199.000	CenterPoint Energy Houston Electric 5,3% 1/4/2053	198.187	0,00	USD 3.000.000	Citigroup 4,412% 31/3/2031	2.785.171	0,04
USD 332.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	336.484	0,01	USD 1.622.121	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 5,257% 11/3/2047	1.564.827	0,02
USD 9.621.000	Century Communities 6,75% 1/6/2027	9.595.444	0,13	USD 3.715.001	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 5,629% 25/5/2037	2.405.309	0,03
USD 5.181.244	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 1,859% 10/1/2048	176.948	0,00	USD 2.332.342	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL3 5,599% 25/7/2045	1.573.497	0,02
USD 5.189.832	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0,851% 10/5/2058	86.139	0,00	USD 2.024.884	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AMC1 5,749% 25/12/2036	1.115.218	0,02
USD 1.710.609	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 4,998% 10/5/2058	1.544.221	0,02	USD 2.791.000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 6,134% 25/3/2037	2.583.119	0,04
				USD 597.000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-C 4,25% 25/2/2054	539.975	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 245.995	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A6 6% 25/6/2037	213.676	0,00	USD 1.625.000	Concentrix 6,65% 2/8/2026	1.626.117	0,02
USD 2.865.000	City of Charlotte Airport Revenue 3% 1/7/2046	2.158.498	0,03	USD 412.019	Conseco Finance 6,63% 1/6/2030	395.257	0,01
USD 1.055.000	City of Riverside Electric Revenue 7,605% 1/10/2040	1.285.820	0,02	USD 183.775	Conseco Finance 6,83% 1/4/2030	176.572	0,00
USD 3.015.000	City of Salt Lake City Airport Revenue 5% 1/7/2046	3.086.601	0,04	USD 1.945.053	Conseco Finance 6,98% 1/9/2030	1.822.216	0,03
USD 3.428.000	Civitas Resources 8,375% 1/7/2028	3.523.996	0,05	USD 353.314	Conseco Finance 7,21% 15/1/2029	339.501	0,00
EUR 2.834.000	Clarios Global / Clarios US Finance 4,375% 15/5/2026	2.977.604	0,04	USD 786.194	Conseco Finance 7,5% 1/3/2030	299.063	0,00
USD 206.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	184.950	0,00	USD 619.190	Conseco Finance 7,53% 15/3/2028	601.513	0,01
USD 4.424.000	Cleveland-Cliffs 6,75% 15/4/2030	4.226.058	0,06	USD 733.047	Conseco Finance 7,86% 1/3/2030	290.284	0,00
USD 8.005.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	7.160.173	0,10	USD 1.774.161	Conseco Finance Securitizations 7,96% 1/5/2031	515.778	0,01
USD 2.490.000	Colorado Health Facilities Authority 4% 15/11/2046	2.321.728	0,03	USD 1.191.186	Conseco Finance Securitizations 8,06% 1/9/2029	242.295	0,00
USD 321.000	Comcast 1,95% 15/1/2031	259.686	0,00	USD 3.228.998	Conseco Finance Securitizations 8,2% 1/5/2031	966.522	0,01
USD 1.500.000	Comcast 2,35% 15/1/2027	1.374.112	0,02	USD 1.472.272	Conseco Finance Securitizations 8,31% 1/5/2032	287.034	0,00
USD 1.750.000	Comcast 3,3% 1/2/2027	1.654.422	0,02	USD 415.000	Conservation Fund A Nonprofit 3,474% 15/12/2029	356.253	0,01
USD 3.250.000	Comcast 3,4% 1/4/2030	2.963.773	0,04	USD 2.748.000	Consumers Energy 4,9% 15/2/2029	2.724.505	0,04
USD 156.000	Comcast 3,55% 1/5/2028	147.210	0,00	USD 850.000	Contra Costa Community College District 6,504% 1/8/2034	937.319	0,01
USD 2.736.000	Comcast 4,65% 15/2/2033	2.675.264	0,04	EUR 2.073.000	Coty 3,875% 15/4/2026	2.187.759	0,03
USD 100.000	COMM 2013-300P Mortgage Trust 4,54% 10/8/2030	80.687	0,00	EUR 300.000	Coty 4,75% 15/4/2026	320.764	0,00
USD 323.283	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 4,813% 10/2/2047	285.136	0,00	USD 325.000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030	324.090	0,00
USD 666.000	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust 3,961% 10/3/2047	659.863	0,01	USD 4.800.000	Countrywide Asset-Backed Certificates 5,864% 25/11/2036	4.364.124	0,06
USD 1.265.000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 4,514% 10/9/2047	1.189.449	0,02	USD 1.495.356	Countrywide Asset-Backed Certificates 5,93% 25/5/2037	1.142.046	0,02
USD 2.691.000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 4,491% 10/8/2048	2.482.361	0,03	USD 850.000	County of Broward Airport System Revenue 2,914% 1/10/2032	714.742	0,01
USD 3.919.612	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 0,942% 10/8/2048	48.000	0,00	USD 2.090.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2,529% 1/10/2030	1.783.469	0,02
USD 1.024.500	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 4,667% 10/8/2048	923.900	0,01	USD 1.588.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	1.367.228	0,02
USD 846.000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3,829% 10/2/2048	771.020	0,01	USD 2.204	Credit Suisse First Boston Mortgage 4,877% 15/4/2037	2.135	0,00
USD 1.316.780	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust 3,774% 10/10/2048	1.254.099	0,02	USD 7.508.217	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 6,5% 27/10/2037	3.053.446	0,04
USD 111.320.422	COMM 2016-667M Mortgage Trust 0,145% 10/10/2036	234.029	0,00	USD 286.193	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 3,053% 25/12/2036	229.475	0,00
USD 1.100.000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 3,285% 10/10/2036	853.398	0,01	USD 1.418.696	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 5,769% 25/7/2037	908.789	0,01
USD 2.910.275	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 1,75% 10/5/2051	185.137	0,00	USD 3.370.922	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6,056% 25/9/2036	183.177	0,00
USD 5.105.000	Commercial Metals 4,125% 15/1/2030	4.523.437	0,06	USD 499.253	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6,75% 25/10/2036	481.400	0,01
USD 1.857.000	Commercial Metals 4,375% 15/3/2032	1.591.587	0,02	USD 11.673.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	11.366.304	0,16
USD 425.000	Commonwealth Financing Authority 4,144% 1/6/2038	380.352	0,01				
USD 295.000	Commonwealth of Massachusetts 2,9% 1/9/2049	203.928	0,00				
USD 1.880.000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/9/2049	1.993.553	0,03				
USD 235.000	Commonwealth of Massachusetts 5,456% 1/12/2039	243.533	0,00				
USD 835.000	Concentrix 6,6% 2/8/2028	817.605	0,01				

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 6.250.000	Crown Castle 2,5% 15/7/2031	5.045.564	0,07	USD 318.997	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H 5,575% 15/11/2036	312.330	0,00
USD 3.408.000	Crown Castle 2,9% 15/3/2027	3.126.416	0,04	USD 467.541	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I 5,565% 15/1/2037	428.441	0,01
USD 2.040.000	Crown Castle 3,1% 15/11/2029	1.774.896	0,02	USD 895.000	DAE Funding 1,55% 1/8/2024	856.399	0,01
USD 1.300.000	Crown Castle 4,3% 15/2/2029	1.220.938	0,02	USD 452.000	DAE Funding 2,625% 20/3/2025*	425.370	0,01
USD 2.561.000	Crown Castle 5% 11/1/2028	2.513.238	0,03	USD 650.000	Dallas Fort Worth International Airport 3,144% 1/11/2045	488.625	0,01
USD 728.000	CrownRock / CrownRock Finance 5,625% 15/10/2025	715.915	0,01	USD 417.000	Dana 4,25% 1/9/2030	342.813	0,00
USD 19.163.000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 0,259% 15/11/2050	195.699	0,00	USD 3.655.051	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6,906% 15/5/2035	3.585.342	0,05
USD 2.494.000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4,864% 15/8/2051	1.986.660	0,03	USD 3.207.307	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7,606% 15/5/2035	3.126.082	0,04
USD 2.937.000	CSC 5,25% 1/6/2024	2.789.865	0,04	USD 4.389.268	DBJPM 2017-C6 Mortgage Trust 1% 10/6/2050	133.303	0,00
USD 2.992.000	CSC 5,5% 15/4/2027	2.582.142	0,04	USD 6.941.235	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	5.425.804	0,08
USD 116.659.107	CSMC 2014-USA OA 0,186% 15/9/2037	160.453	0,00	USD 2.469.265	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	1.917.739	0,03
USD 770.000	CSMC 2017-TIME 3,646% 13/11/2039	657.495	0,01	USD 1.080.000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	870.361	0,01
USD 451.695	CSMC Series 2014-4R 4,498% 27/2/2036	430.682	0,01	USD 1.432.000	Dell International / EMC 6,02% 15/6/2026	1.446.672	0,02
USD 1.239.491	CSMC Series 2015-4R 3,931% 27/10/2036	915.652	0,01	USD 4.471.802	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4 5,769% 25/8/2047	3.945.396	0,06
USD 790.000	CSMC Trust 2017-PFHP 6,308% 15/12/2030	754.944	0,01	USD 157.555	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6,364% 25/7/2036	127.415	0,00
USD 2.815.000	CVS Health 1,3% 21/8/2027	2.421.632	0,03	USD 246.830	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6,51% 25/7/2036	199.585	0,00
USD 5.037.000	CVS Health 1,75% 21/8/2030	4.000.383	0,06	USD 2.472.000	DISH DBS 5,875% 15/11/2024	2.305.267	0,03
USD 4.590.000	CVS Health 1,875% 28/2/2031	3.599.506	0,05	USD 1.660.000	DISH Network 0% 15/12/2025	1.077.158	0,02
USD 500.000	CVS Health 2,875% 1/6/2026	468.184	0,01	USD 900.000	District of Columbia 5% 15/7/2034	922.845	0,01
USD 815.000	CVS Health 3,625% 1/4/2027	771.332	0,01	USD 900.000	District of Columbia 5% 15/7/2035	917.079	0,01
USD 3.746.220	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 4,52% 25/4/2036	3.212.363	0,04	USD 2.150.000	Dollar General 3,5% 3/4/2030	1.913.387	0,03
USD 2.938.323	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 6,547% 25/5/2036	2.319.961	0,03	USD 1.045.000	Dollar General 3,875% 15/4/2027	997.634	0,01
USD 803.344	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 5,689% 25/12/2036	724.068	0,01	USD 1.026.000	Dresdner Funding Trust I 8,151% 30/6/2031	1.099.103	0,02
USD 8.157	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 5,749% 25/9/2046	8.108	0,00	EUR 3.207.000	Duke Energy 3,1% 15/6/2028	3.310.277	0,05
USD 6.207.634	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-18 5,879% 25/3/2037	4.921.641	0,07	USD 2.214.000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	2.260.284	0,03
USD 1.259.186	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-22 5,659% 25/5/2047	1.005.076	0,01	USD 757.000	Eaton 4,35% 18/5/2028	742.938	0,01
USD 197.031	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U 5,695% 15/3/2034	190.583	0,00	USD 5.100.000	Ecolab 2,125% 1/2/2032	4.153.438	0,06
USD 124.351	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S3 5,631% 25/1/2029	180.145	0,00	USD 2.000.000	Ecolab 5,25% 15/1/2028	2.026.318	0,03
USD 62.418	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 6,155% 25/6/2035	74.771	0,00	USD 750.000	Edison International 6,95% 15/11/2029	789.767	0,01
USD 172.856	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 5,615% 15/5/2035	172.359	0,00	USD 3.426.000	Elevance Health 1,5% 15/3/2026	3.111.119	0,04
USD 35.756	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 5,615% 15/5/2035	35.346	0,00	USD 4.555.000	Elevance Health 2,55% 15/3/2031	3.813.696	0,05
USD 118.472	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B 5,605% 15/5/2035	116.999	0,00	USD 1.750.000	Elevance Health 2,875% 15/9/2029	1.544.462	0,02
USD 624.806	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C 5,605% 15/5/2036	603.046	0,01	USD 715.000	Elevance Health 3,65% 1/12/2027	674.037	0,01
				USD 750.000	Elevance Health 4,1% 15/5/2032	692.554	0,01
				USD 2.000.000	Elevance Health 4,9% 8/2/2026	1.972.591	0,03
				USD 1.260.000	Elmwood CLO 15 6,686% 22/4/2035	1.251.570	0,02
				USD 2.750.000	Elmwood CLO 15 9,016% 22/4/2035	2.691.625	0,04
				EUR 396.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	429.735	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.049.000	Emerald Debt Merger Sub 6,625% 15/12/2030	1.032.281	0,01	USD 2.920.000	Fifth Third Bancorp 6,339% 27/7/2029	2.953.478	0,04
EUR 1.725.000	Encore Capital 4,875% 15/10/2025*	1.789.922	0,02	USD 799.734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 6,479% 25/10/2034	729.801	0,01
GBP 600.000	Encore Capital 5,375% 15/2/2026*	685.832	0,01	USD 1.388.150	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5,669% 25/10/2036	927.431	0,01
USD 1.500.000	Enterprise Products Operating 2,8% 31/1/2030	1.300.418	0,02	USD 814.047	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5,749% 25/10/2036	527.346	0,01
USD 750.000	Enterprise Products Operating 3,125% 31/7/2029	671.136	0,01	USD 5.229.216	First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-FF2 5,709% 25/3/2037	2.825.604	0,04
USD 900.000	EQM Midstream Partners 7,5% 1/6/2027	908.734	0,01	GBP 800.000	Fiserv 2,25% 1/7/2025	948.779	0,01
USD 595.000	EQM Midstream Partners 7,5% 1/6/2030	610.887	0,01	USD 7.341.000	Five Point Operating / Five Point Capital 7,875% 15/11/2025*	6.886.959	0,10
USD 1.500.000	Equinix 1,25% 15/7/2025	1.382.390	0,02	USD 3.140.322	Flagstar Mortgage Trust 2018-6RR 4,921% 25/10/2048	2.686.825	0,04
USD 625.000	Equinix 2,9% 18/11/2026	577.355	0,01	USD 2.174.000	Florida Power & Light 4,4% 15/5/2028	2.124.821	0,03
USD 2.020.000	Equinix 3,2% 18/11/2029	1.767.813	0,02	USD 1.144.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032	894.740	0,01
USD 6.123.000	EquipmentShare.com 9% 15/5/2028	6.090.276	0,08	USD 2.667.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	2.545.507	0,03
USD 1.681.000	Eversource Energy 2,9% 1/10/2024	1.630.996	0,02	GBP 1.560.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	1.891.274	0,03
USD 2.085.000	Eversource Energy 4,75% 15/5/2026	2.050.650	0,03	EUR 875.000	Ford Motor Credit 4,867% 3/8/2027	936.976	0,01
USD 1.118.000	Exelon 2,75% 15/3/2027	1.025.746	0,01	USD 1.579.000	Ford Motor Credit 5,584% 18/3/2024	1.571.409	0,02
USD 8.977.089	Fannie Mae Interest Strip 3% 25/10/2049	1.424.374	0,02	EUR 618.000	Ford Motor Credit 6,125% 15/5/2028	688.512	0,01
USD 21.083.529	Fannie Mae Interest Strip 3% 25/3/2050	3.615.705	0,05	GBP 5.605.000	Ford Motor Credit 6,86% 5/6/2026*	6.935.400	0,10
USD 8.734.890	Fannie Mae Interest Strip 3,5% 25/8/2049	1.559.437	0,02	USD 739.000	Forestar 3,85% 15/5/2026	685.780	0,01
USD 25.184	Fannie Mae Pool 3,5% 1/1/2048	23.044	0,00	USD 5.361.000	Forestar 5% 1/3/2028	4.964.290	0,07
USD 159.064	Fannie Mae Pool 3,5% 1/12/2050	144.877	0,00	USD 18.533.943	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0,941% 25/5/2029	638.077	0,01
USD 619.198	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2048	583.719	0,01	USD 30.127.000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,024% 25/6/2029	1.328.824	0,02
USD 699.200	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2048	654.568	0,01	USD 6.910.758	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,119% 25/10/2030	380.116	0,01
USD 515.182	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2048	484.402	0,01	USD 3.380.000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,467% 25/12/2029	195.843	0,00
USD 510.957	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2048	480.429	0,01	USD 13.537.109	Freddie Mac Pool 4% 1/3/2050	12.732.212	0,18
USD 1.505.284	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2048	1.410.837	0,02	USD 7.713.717	Freddie Mac Pool 4% 1/5/2050	7.184.301	0,10
USD 13.462.395	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2049	12.596.714	0,17	USD 1.287.059	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2050	214.491	0,00
USD 4.155.007	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2050	3.872.500	0,05	USD 3.327.193	Freddie Mac REMICS 3% 25/3/2051	549.663	0,01
USD 232.513	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	217.700	0,00	USD 2.826.206	Freddie Mac REMICS 3% 25/6/2051	452.079	0,01
USD 1.510.794	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	1.411.528	0,02	USD 1.307.393	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	211.674	0,00
USD 5.568.073	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2050	5.201.700	0,07	USD 3.449.904	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	510.738	0,01
USD 1.614.654	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2050	1.507.517	0,02	USD 1.666.576	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	260.534	0,00
USD 346.508	Fannie Mae Pool 4% 1/11/2050	323.701	0,00	USD 3.725.181	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	625.865	0,01
USD 34.901.812	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2051	32.621.600	0,45				
USD 39.667.001	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2051	37.042.488	0,51				
USD 4.980.449	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2051	4.640.595	0,06				
USD 19.160.248	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2051	17.884.894	0,25				
USD 518.775	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2052	487.053	0,01				
USD 10.463.491	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	9.728.927	0,14				
USD 8.350.874	Fannie Mae REMICS 3,5% 25/2/2051	1.499.191	0,02				
USD 3.016.779	Fannie Mae REMICS 4% 25/5/2050	622.583	0,01				
USD 10.489.417	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	2.111.435	0,03				
USD 9.610.053	Fannie Mae REMICS 4% 25/6/2051	1.914.297	0,03				
USD 4.124.187	Fannie Mae REMICS 4% 25/8/2051	774.886	0,01				
EUR 1.000.000	Fidelity National Information Services 0,625% 3/12/2025	1.009.704	0,01				
USD 1.256.000	Fidelity National Information Services 1,15% 1/3/2026	1.130.182	0,02				
EUR 2.550.000	Fidelity National Information Services 1,5% 21/5/2027	2.539.651	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 11.792.592	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	1.572.015	0,02	EUR 3.407.000	Global Payments 4,875% 17/3/2031	3.694.265	0,05
USD 11.794.726	Freddie Mac REMICS 3% 25/2/2052	1.994.460	0,03	USD 1.086.000	GLP Capital / GLP Financing II 4% 15/1/2031	932.435	0,01
USD 4.851.967	Freddie Mac REMICS 3,5% 25/3/2051	841.494	0,01	USD 904.000	Golden Entertainment 7,625% 15/4/2026	898.151	0,01
USD 7.975.642	Freddie Mac REMICS 3,5% 25/6/2051	1.457.781	0,02	EUR 3.000.000	Goldman Sachs 0,875% 9/5/2029	2.684.377	0,04
USD 3.810.424	Freddie Mac REMICS 3,5% 25/10/2051	693.810	0,01	USD 3.340.000	Goldman Sachs 1,093% 9/12/2026	2.996.297	0,04
USD 8.016.646	Freddie Mac REMICS 4% 25/12/2050	1.562.474	0,02	EUR 4.000.000	Goldman Sachs 1,25% 7/2/2029	3.691.700	0,05
USD 4.655.448	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 8,688% 25/1/2042	4.626.374	0,06	USD 1.709.000	Goldman Sachs 1,431% 9/3/2027	1.532.108	0,02
USD 50.382.931	Freddie Mac Strips 3% 15/10/2052	8.346.873	0,12	USD 6.500.000	Goldman Sachs 1,542% 10/9/2027	5.736.611	0,08
USD 401.109	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 13,352% 25/5/2025	404.111	0,01	USD 1.510.000	Goldman Sachs 1,948% 21/10/2027	1.342.917	0,02
USD 214.257	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 16,902% 25/1/2025	217.781	0,00	USD 1.500.000	Goldman Sachs 1,992% 27/1/2032	1.169.132	0,02
USD 1.337.000	Freedom Mortgage 8,125% 15/11/2024	1.332.060	0,02	USD 750.000	Goldman Sachs 2,383% 21/7/2032*	592.947	0,01
USD 767.000	Freedom Mortgage 8,25% 15/4/2025	755.683	0,01	USD 1.125.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	911.203	0,01
USD 782.435	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust 3,715% 25/10/2027	713.930	0,01	USD 4.250.000	Goldman Sachs 2,65% 21/10/2032	3.412.517	0,05
USD 4.972.000	FREMF 2018-KW05 Trust 3,786% 25/4/2028	4.184.232	0,06	USD 1.300.000	Goldman Sachs 3,5% 23/1/2025	1.259.523	0,02
USD 83.237.874	FREMF 2019-KW08 Mortgage Trust 0,1% 25/1/2029	307.968	0,00	USD 4.633.000	Goldman Sachs 3,615% 15/3/2028	4.332.304	0,06
USD 2.755.116	Fremont Home Loan Trust 2006-3 5,709% 25/2/2037	2.127.596	0,03	GBP 1.000.000	Goldman Sachs 7,25% 10/4/2028	1.318.921	0,02
USD 3.100.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	2.824.913	0,04	USD 4.672.078	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2,1% 20/5/2048	3.570.947	0,05
USD 3.365.000	Frontier Communications 8,625% 15/3/2031	3.230.883	0,05	USD 3.373.596	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2,31% 20/10/2048	2.605.370	0,04
USD 3.925.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	3.810.380	0,05	USD 8.588.000	GoTo 5,5% 1/9/2027	5.031.572	0,07
USD 4.910.000	Frontier Florida 6,86% 1/2/2028	4.579.704	0,06	USD 2.394.789	Government National Mortgage Association 0,519% 16/9/2053	33.899	0,00
USD 1.125.000	Frontier North 6,73% 15/2/2028	1.026.186	0,01	USD 462.128	Government National Mortgage Association 0,618% 16/10/2056	12.082	0,00
USD 15.753.000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7,894% 17/8/2037	15.831.795	0,22	USD 565.174	Government National Mortgage Association 0,679% 16/8/2057	16.168	0,00
USD 776.000	Full House Resorts 8,25% 15/2/2028*	691.138	0,01	USD 2.828.723	Government National Mortgage Association 0,77% 16/12/2057	103.752	0,00
USD 1.956.311	GAM Resecuritization Trust 2018-B 6,5% 27/8/2051	1.833.758	0,03	USD 370.979	Government National Mortgage Association 0,923% 16/2/2050	8.629	0,00
USD 205.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	218.627	0,00	USD 3.277.507	Government National Mortgage Association 2,5% 20/9/2050	428.876	0,01
USD 2.410.000	Gen Digital 6,75% 30/9/2027	2.411.275	0,03	USD 5.622.041	Government National Mortgage Association 2,5% 20/10/2050	662.947	0,01
USD 1.755.000	Gen Digital 7,125% 30/9/2030	1.770.539	0,02	USD 2.831.373	Government National Mortgage Association 2,5% 20/10/2050	372.007	0,01
USD 750.000	General Mills 2,875% 15/4/2030	655.936	0,01	USD 954.600	Government National Mortgage Association 2,5% 20/11/2050	125.148	0,00
USD 800.000	General Mills 4,2% 17/4/2028	766.757	0,01	USD 3.480.626	Government National Mortgage Association 2,5% 20/12/2050	458.546	0,01
USD 3.500.000	General Motors Financial 2,35% 26/2/2027	3.112.458	0,04	USD 1.538.901	Government National Mortgage Association 3% 20/8/2050	231.860	0,00
GBP 1.300.000	General Motors Financial 5,15% 15/8/2026	1.602.730	0,02	USD 1.497.560	Government National Mortgage Association 3% 20/4/2051	212.286	0,00
USD 1.499.000	General Motors Financial 5,4% 6/4/2026	1.481.315	0,02	USD 25.089.161	Government National Mortgage Association 3% 20/5/2051	3.683.502	0,05
USD 700.000	Georgia-Pacific 0,95% 15/5/2026	621.430	0,01				
USD 1.000.000	Georgia-Pacific 2,3% 30/4/2030	840.416	0,01				
USD 1.950.000	Gilead Sciences 1,65% 1/10/2030	1.566.037	0,02				
USD 2.750.000	Gilead Sciences 3,65% 1/3/2026	2.642.678	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.685.284	Government National Mortgage Association 3% 20/6/2051	404.582	0,01	USD 6.820.249	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-12 5,838% 19/12/2036	5.384.709	0,07
USD 13.521.407	Government National Mortgage Association 3% 20/8/2051	2.040.133	0,03	USD 362.316	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 5,678% 19/7/2047	333.907	0,01
USD 2.074.515	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	247.123	0,00	USD 2.800.000	Hays Consolidated Independent School District 4% 15/2/2047	2.611.637	0,04
USD 1.202.223	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	143.639	0,00	USD 1.328.000	HCA 3,125% 15/3/2027	1.218.894	0,02
USD 1.786.699	Government National Mortgage Association 3,5% 20/1/2051	300.050	0,00	USD 1.400.000	HCA 3,5% 1/9/2030	1.223.542	0,02
USD 2.718.737	Government National Mortgage Association 3,5% 20/10/2051	427.836	0,01	USD 1.000.000	HCA 3,625% 15/3/2032	860.046	0,01
USD 1.215.155	Government National Mortgage Association 3,5% 20/11/2051	166.672	0,00	USD 4.700.000	HCA 4,5% 15/2/2027	4.540.891	0,06
USD 1.850.148	Government National Mortgage Association 4% 20/5/2051	357.760	0,01	USD 3.576.000	HCA 5,375% 1/2/2025	3.552.535	0,05
USD 1.154.819	Government National Mortgage Association 4% 20/9/2051	183.141	0,00	USD 2.045.000	HCA 5,875% 1/2/2029	2.055.698	0,03
USD 2.649.694	Government National Mortgage Association 4% 20/12/2051	417.405	0,01	USD 1.000.000	Healthpeak 1,35% 1/2/2027	876.549	0,01
USD 333.000	GrafTech Global Enterprises 9,875% 15/12/2028	323.137	0,00	USD 684.000	Healthpeak 5,25% 15/12/2032	660.531	0,01
USD 731.000	Grand Canyon University 3,25% 1/10/2023	721.862	0,01	USD 6.200.000	Home Depot 1,375% 15/3/2031	4.858.632	0,07
USD 2.102.000	Grand Canyon University 5,125% 1/10/2028	1.899.788	0,03	USD 3.000.000	Home Depot 2,95% 15/6/2029	2.722.275	0,04
EUR 316.000	Graphic Packaging International 2,625% 1/2/2029	302.668	0,00	USD 1.190.000	Home Equity Asset Trust 2006-3 6,029% 25/7/2036	1.073.454	0,01
USD 259.044	Greenpoint Manufactured Housing 8,29% 15/12/2029	257.537	0,00	USD 1.446.216	Home Equity Asset Trust 2007-1 5,729% 25/5/2037	1.105.906	0,02
USD 772.575	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 6,43% 25/3/2036	681.471	0,01	USD 6.519.759	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E 5,599% 25/4/2037	4.518.014	0,06
USD 25.000.000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 0,395% 3/5/2032	94.765	0,00	USD 6.774.716	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 5,669% 25/4/2037	4.398.584	0,06
USD 2.452.265	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5,366% 3/5/2032	2.375.679	0,03	USD 262.607	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A 3,726% 25/7/2034	252.626	0,00
USD 110.000	GS Mortgage Trust 2014-GC20 4,529% 10/4/2047	103.773	0,00	USD 204.000	Horizon Therapeutics USA 5,5% 1/8/2027	208.574	0,00
USD 730.000	GS Mortgage Trust 2015-590M 3,932% 10/10/2035	610.094	0,01	USD 2.073.000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3,982% 5/3/2037	1.879.710	0,03
USD 1.455.000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 4,554% 10/7/2048	1.303.940	0,02	USD 2.120.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	1.914.520	0,03
USD 440.000	GS Mortgage Trust 2017-375H 3,591% 10/9/2037	390.257	0,01	USD 65.000	iHeartCommunications 4,75% 15/1/2028	50.184	0,00
USD 2.170.000	GS Mortgage Trust 2017-GPTX 2,856% 10/5/2034	1.586.812	0,02	USD 98.000	iHeartCommunications 5,25% 15/8/2027	77.858	0,00
USD 9.680.133	GSA Home Equity Trust 2006-5 5,789% 25/3/2036	3.194.787	0,04	USD 104.490	iHeartCommunications 6,375% 1/5/2026	91.192	0,00
USD 417.260	GSA Home Equity Trust 2007-2 5,917% 25/3/2037	83.142	0,00	USD 464.752	Impac Secured Assets Trust 2006-3 5,769% 25/11/2036	412.365	0,01
USD 880.273	GSAMP Trust 2007-H1 5,829% 25/1/2047	451.562	0,01	USD 1.210.000	IMT Trust 2017-APTS 3,478% 15/6/2034	1.175.445	0,02
USD 2.000.000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 8,804% 25/2/2047	1.863.818	0,03	USD 5.620.171	IMT Trust 2017-APTS 3,613% 15/6/2034	5.382.499	0,07
USD 756.860	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP1 5,779% 25/1/2035	640.272	0,01	USD 2.669.820	IMT Trust 2017-APTS 3,613% 15/6/2034	2.578.946	0,04
USD 2.826.791	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP2 5,779% 25/3/2035	2.465.446	0,03	USD 2.000.000	IMT Trust 2017-APTS 3,613% 15/6/2034	1.902.192	0,03
USD 725.054	GSMPs Mortgage Loan Trust 2006-RP1 5,779% 25/1/2036	587.771	0,01	USD 370.000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3,911% 10/7/2035	344.486	0,01
USD 1.658.781	GSR Mortgage Loan Trust 2006-7F 6,5% 25/8/2036	595.040	0,01	USD 800.000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 4,158% 10/7/2035	740.685	0,01
USD 411.870	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F 5,5% 25/1/2037	529.165	0,01	USD 2.317.513	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 0% 25/7/2047	1.650	0,00
USD 3.940.246	GSR Mortgage Loan Trust 2007-OA2 2,929% 25/6/2047	2.526.296	0,04	USD 434.749	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 5,669% 25/7/2036	423.924	0,01
USD 2.377.000	GXO Logistics 2,65% 15/7/2031	1.862.928	0,03	USD 3.487.702	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR35 5,789% 25/1/2037	3.077.213	0,04

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 4.006.027	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 3,689% 25/9/2037	2.736.443	0,04	USD 312.000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2018-C8 4,421% 15/6/2051	278.222	0,00
USD 457.722	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 5,669% 25/8/2037	402.615	0,01	GBP 2.600.000	JPMorgan Chase 0,991% 28/4/2026	3.041.956	0,04
USD 2.785.000	Intercontinental Exchange 1,85% 15/9/2032	2.121.676	0,03	EUR 2.900.000	JPMorgan Chase 1,638% 18/5/2028	2.886.531	0,04
USD 1.500.000	Intercontinental Exchange 3,1% 15/9/2027	1.387.706	0,02	USD 1.500.000	JPMorgan Chase 1,764% 19/11/2031	1.174.389	0,02
USD 200.000	IQVIA 5% 15/5/2027	192.299	0,00	USD 1.709.000	JPMorgan Chase 2,083% 22/4/2026	1.606.894	0,02
USD 261.783	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 6,53% 25/9/2037	243.935	0,00	USD 1.664.000	JPMorgan Chase 2,182% 1/6/2028	1.477.386	0,02
USD 73.742	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 5,709% 25/12/2036	70.736	0,00	USD 1.125.000	JPMorgan Chase 2,739% 15/10/2030	963.904	0,01
USD 10.068.590	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 5,659% 25/5/2037	2.421.714	0,03	USD 4.610.000	JPMorgan Chase 3,702% 6/5/2030	4.206.712	0,06
USD 3.813.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-NINE 2,949% 6/9/2038	3.217.425	0,04	USD 5.465.000	JPMorgan Chase 4,08% 26/4/2026	5.328.839	0,07
USD 1.455.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-AON 4,128% 5/7/2031	1.334.508	0,02	USD 12.611.000	JPMorgan Chase 4,323% 26/4/2028	12.113.768	0,17
USD 4.428.722	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-PHH 6,567% 15/6/2035	4.137.876	0,06	USD 4.143.000	JPMorgan Chase 4,851% 25/7/2028	4.061.392	0,06
USD 1.270.000	JobsOhio Beverage System 3,985% 1/1/2029	1.237.536	0,02	USD 4.455.000	JPMorgan Chase 6,577% 2/2/2037	3.836.269	0,05
USD 255.000	Johnson & Son 3,35% 30/9/2024	248.229	0,00	USD 4.150.000	Keurig Dr Pepper 3,95% 15/4/2029	3.903.761	0,05
USD 186.384	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 4,47% 25/5/2037	169.950	0,00	USD 4.135.000	Keurig Dr Pepper 4,597% 25/5/2028	4.036.639	0,06
USD 2.321.741	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4,881% 15/1/2049	1.952.264	0,03	USD 4.801.011	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A 6,869% 28/7/2042	4.487.627	0,06
USD 10.620.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-JP3 0,75% 15/8/2049	203.194	0,00	USD 4.900.135	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A 6,844% 27/12/2038	4.677.418	0,06
USD 217.929	JP Morgan Madison Avenue Trust Series 2014-1 9,652% 25/11/2024	215.157	0,00	USD 1.875.000	Kraft Heinz Foods 3,75% 1/4/2030	1.718.588	0,02
USD 619.245	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 5,834% 25/5/2036	594.650	0,01	GBP 609.000	Kraft Heinz Foods 4,125% 1/7/2027	730.275	0,01
USD 4.655.000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH1 4,589% 25/11/2036	4.557.849	0,06	USD 1.325.000	Kraft Heinz Foods 4,25% 1/3/2031	1.241.728	0,02
USD 1.092.441	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C22 0,945% 15/9/2047	4.361	0,00	EUR 1.840.000	Kronos International 3,75% 15/9/2025*	1.819.447	0,03
USD 837.772	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 0,737% 15/9/2047	3.235	0,00	USD 1.796.402	Ladder Capital Commercial Mortgage 2013-GCP Mortgage Trust 1,322% 15/2/2036	72.670	0,00
USD 7.006.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C27 0,5% 15/2/2048	48.203	0,00	USD 166.919	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 0% 15/6/2033	155.004	0,00
USD 1.139.081	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C29 0,692% 15/5/2048	8.271	0,00	USD 252.048	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 2007-1 5,519% 25/6/2037	160.305	0,00
USD 1.480.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 4,29% 15/12/2048	1.118.631	0,02	USD 718.341	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 5,879% 25/9/2036	623.982	0,01
USD 1.198.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4,359% 17/3/2049	981.754	0,01	USD 29.069	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 5,679% 25/3/2037	28.790	0,00
USD 4.150.000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0,75% 15/12/2049	80.659	0,00	USD 6.294.000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-3 7,429% 25/10/2037	5.344.083	0,07
				USD 896.955	Lehman XS Trust Series 2007-16N 7,329% 25/9/2047	1.125.260	0,02
				USD 448.426	Lehman XS Trust Series 2007-20N 7,729% 25/12/2037	451.446	0,01
				USD 659.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	603.355	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 2.992.000	Liberty Mutual 3,625% 23/5/2059	3.098.586	0,04	USD 814.332	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 5,609% 25/6/2037	185.992	0,00
USD 5.928.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	3.587.946	0,05	USD 147.000	Metropolitan Life Global Funding I 1,875% 11/1/2027	131.285	0,00
USD 8.440.064	Loanpal Solar Loan 2,47% 20/12/2047	6.393.403	0,09	USD 33.000	MGM Resorts International 4,625% 1/9/2026	31.115	0,00
USD 2.691.557	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 5,729% 25/6/2036	1.265.397	0,02	USD 357.000	MGM Resorts International 5,5% 15/4/2027	340.604	0,00
USD 732.375	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 5,729% 25/7/2036	292.372	0,00	USD 32.000	MGM Resorts International 5,75% 15/6/2025	31.614	0,00
USD 5.927.006	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 5,749% 25/8/2036	2.369.257	0,03	USD 1.876.000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4,875% 1/5/2029	1.633.852	0,02
USD 1.850.000	Louisiana Public Facilities Authority 3% 15/5/2047	1.249.290	0,02	EUR 1.102.000	Moody's 0,95% 25/2/2030	1.007.317	0,01
USD 2.310.000	Lowe's 1,7% 15/10/2030	1.834.977	0,02	EUR 1.600.000	Morgan Stanley 0,495% 26/10/2029	1.436.951	0,02
USD 3.250.000	Lowe's 2,625% 1/4/2031	2.728.944	0,04	EUR 5.000.000	Morgan Stanley 1,102% 29/4/2033	4.174.004	0,06
USD 2.050.000	Lowe's 3,1% 3/5/2027	1.907.137	0,03	USD 360.000	Morgan Stanley 1,512% 20/7/2027	319.442	0,00
USD 2.251.000	Lowe's 3,35% 1/4/2027	2.117.930	0,03	USD 1.500.000	Morgan Stanley 1,794% 13/2/2032	1.154.804	0,02
USD 750.000	Lowe's 3,75% 1/4/2032	671.906	0,01	USD 5.498.000	Morgan Stanley 2,475% 21/1/2028	4.959.052	0,07
USD 1.125.000	Lowe's 4,5% 15/4/2030	1.084.507	0,01	USD 4.250.000	Morgan Stanley 2,699% 22/1/2031	3.577.629	0,05
USD 807.000	Lowe's 4,8% 1/4/2026	797.230	0,01	EUR 10.500.000	Morgan Stanley 2,95% 7/5/2032	10.334.076	0,15
USD 190.177	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 3,279% 20/4/2048	183.326	0,00	USD 1.200.000	Morgan Stanley 3,622% 1/4/2031	1.066.632	0,01
USD 1.912.685	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 0,955% 10/3/2050	31.501	0,00	USD 8.706.000	Morgan Stanley 4,21% 20/4/2028	8.322.848	0,12
USD 1.885.000	Lyford Consolidated Independent School District 4% 15/8/2047	1.748.011	0,02	USD 375.000	Morgan Stanley 4,431% 23/1/2030	355.517	0,01
USD 3.192.000	M/I Homes 4,95% 1/2/2028	2.963.619	0,04	EUR 2.700.000	Morgan Stanley 4,656% 2/3/2029	2.961.458	0,04
USD 4.008.000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4,108% 15/8/2034	3.401.790	0,05	USD 4.034.000	Morgan Stanley 5,05% 28/1/2027	3.988.393	0,06
USD 3.529.000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4,167% 15/8/2034	2.709.833	0,04	USD 700.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	695.131	0,01
USD 159.205	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 8,679% 25/3/2032	159.234	0,00	USD 2.230.457	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2005-HE5 6,299% 25/9/2035	1.833.947	0,03
USD 290.000	Massachusetts Housing Finance Agency 4,5% 1/12/2039	278.237	0,00	USD 286.246	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2007-SEA1 9,229% 25/2/2047	261.577	0,00
USD 3.520.000	Massachusetts School Building Authority 2,866% 15/10/2031	3.025.895	0,04	USD 3.765.000	Morgan Stanley Bank 4,754% 21/4/2026	3.711.866	0,05
USD 2.545.000	Massachusetts School Building Authority 2,966% 15/10/2032	2.166.344	0,03	USD 1.862.000	Morgan Stanley Bank 5,479% 16/7/2025	1.862.608	0,03
USD 1.401.845	Mastr Asset Backed Trust 2007-HE1 5,709% 25/5/2037	1.082.232	0,01	USD 3.654.543	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1,328% 15/12/2047	54.205	0,00
USD 308.436	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 5,472% 25/8/2037	184.212	0,00	USD 10.520.884	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1,328% 15/12/2047	140.706	0,00
USD 237.373	Mastr Specialized Loan Trust 5,949% 25/6/2046	225.386	0,00	USD 3.349.202	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 0,41% 15/3/2048	14.055	0,00
USD 143.000	Matador Resources 5,875% 15/9/2026	139.559	0,00	USD 1.500.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4,468% 15/5/2048	1.372.635	0,02
USD 7.007.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	6.892.303	0,10	USD 209.922	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 4,668% 15/10/2048	186.687	0,00
USD 11.511.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	10.031.475	0,14				
USD 920.092	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 5,849% 25/4/2037	834.358	0,01				
USD 4.411.712	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 5,909% 25/5/2037	3.191.198	0,04				
USD 4.204.934	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-H1 8,929% 25/10/2037	3.793.708	0,05				

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 5.104.909	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 1,452% 15/10/2048	125.385	0,00	USD 188.563	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-FL1 6,375% 15/6/2035	182.022	0,00
USD 362.592	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2,73% 15/12/2050	220.727	0,00	USD 2.882.000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 3,5% 15/8/2044	2.659.262	0,04
USD 2.519.058	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 2,307% 15/6/2050	171.956	0,00	USD 2.174.000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A 3,5% 15/12/2044	1.932.938	0,03
USD 1.617.856	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 4,281% 15/6/2050	1.283.002	0,02	USD 1.200.000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3,16% 15/11/2068	1.007.335	0,01
USD 2.754.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	1.866.398	0,03	USD 2.110.000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-H 2,95% 15/4/2069	1.575.303	0,02
USD 225.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	194.223	0,00	USD 700.000	Netflix 4,875% 15/4/2028	689.035	0,01
USD 690.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 6,58% 15/7/2035	685.698	0,01	USD 700.000	Netflix 5,875% 15/2/2025	703.769	0,01
USD 1.213.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 6,88% 15/7/2035	1.202.309	0,02	USD 2.000.000	Netflix 5,875% 15/11/2028	2.059.148	0,03
USD 23.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 8,23% 15/7/2035	22.610	0,00	USD 3.396.243	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 6,149% 25/10/2035	3.267.023	0,05
USD 702.064	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 2006-3 5,749% 25/4/2036	505.076	0,01	USD 2.663.773	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-C 6,104% 25/12/2035	2.122.639	0,03
USD 1.423.782	Morgan Stanley Resecuritization Trust 2013-R7 5,732% 26/12/2046	1.308.259	0,02	USD 639.000	New Home 8,25% 15/10/2027	612.005	0,01
USD 630.775	Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2014-1 6,683% 25/6/2044	615.605	0,01	USD 1.155.000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 3% 1/7/2051	781.820	0,01
USD 1.840.005	Mortgage Loan Resecuritization Trust 5,773% 16/4/2036	1.760.853	0,02	USD 1.150.000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5,754% 15/12/2028	1.164.601	0,02
USD 1.438.113	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1 4,01% 22/6/2043	1.309.421	0,02	USD 1.515.000	New York City Municipal Water Finance Authority 5,44% 15/6/2043	1.569.039	0,02
USD 3.630.899	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 4,2% 22/2/2044	3.275.913	0,05	USD 435.000	New York City Municipal Water Finance Authority 5,75% 15/6/2041	461.923	0,01
USD 606.009	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 5,97% 22/2/2044	507.040	0,01	GBP 1.170.000	New York Life Global Funding 4,35% 16/9/2025	1.435.890	0,02
USD 4.536.640	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 4,37% 21/12/2043	4.155.538	0,06	USD 1.245.000	New York State Urban Development 3,32% 15/3/2029	1.155.448	0,02
USD 861.017	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4,38% 21/1/2053	800.425	0,01	USD 1.480.000	New York State Urban Development 4% 15/3/2038	1.477.085	0,02
USD 4.307.077	MSCG Trust 2018-SELF 7,508% 15/10/2037	4.216.432	0,06	USD 1.224.000	Nexstar Media 4,75% 1/11/2028	1.075.263	0,02
USD 402.103	MSCG Trust 2018-SELF 8,408% 15/10/2037	394.659	0,01	USD 737.000	Nexstar Media 5,625% 15/7/2027	693.566	0,01
USD 422.740	Multi Security Asset Trust Commercial Mortgage-Backed Pass-Through 4,78% 28/11/2035	284.028	0,00	USD 1.500.000	NextEra Energy Capital 1,9% 15/6/2028	1.287.894	0,02
USD 1.425.233	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 6,5% 25/3/2034	1.214.898	0,02	USD 1.075.000	NextEra Energy Capital 4,625% 15/7/2027	1.047.960	0,01
USD 327.234	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 7,5% 25/3/2034	288.378	0,00	USD 2.960.000	NextEra Energy Capital 5,749% 1/9/2025	2.968.464	0,04
EUR 2.080.000	Nasdaq 4,5% 15/2/2032	2.296.133	0,03	USD 711.000	NextEra Energy Capital 6,051% 1/3/2025	713.677	0,01
USD 1.390.000	Nasdaq 5,35% 28/6/2028	1.388.523	0,02	USD 179.872	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 7% 19/2/2030	172.701	0,00
USD 878.000	Nasdaq 5,65% 28/6/2025	878.740	0,01	USD 608.845	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2005-AP1 6,046% 25/2/2035	581.153	0,01
EUR 783.000	National Grid North America 1,054% 20/1/2031	682.201	0,01	USD 443.543	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 7,134% 25/5/2036	87.830	0,00
USD 1.620.000	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-B 5,839% 25/4/2037	1.460.470	0,02	USD 67.531	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-S5 5,829% 25/10/2036	77.177	0,00
USD 1.680.000	Nationstar Mortgage 5,125% 15/12/2030	1.419.293	0,02	USD 1.354.049	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2007-2 5,849% 25/6/2037	1.180.501	0,02
USD 1.832.000	Nationstar Mortgage 5,5% 15/8/2028	1.666.891	0,02				
USD 794.000	Nationstar Mortgage 5,75% 15/11/2031	681.705	0,01				
USD 648.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	617.810	0,01				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.669.000	Norfolk Southern 5,05% 1/8/2030	1.650.929	0,02	USD 1.869.375	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 5,82% 25/3/2037	1.623.592	0,02
USD 1.189.000	Northern Oil and Gas 8,75% 15/6/2031	1.215.438	0,02	USD 2.000.000	Oracle 1,65% 25/3/2026	1.821.562	0,03
USD 4.395.000	Northern States Power 2,9% 1/3/2050	2.899.199	0,04	USD 1.000.000	Oracle 2,3% 25/3/2028	879.805	0,01
USD 4.835.000	NVIDIA 2,85% 1/4/2030	4.340.419	0,06	USD 1.500.000	Oracle 2,875% 25/3/2031	1.267.753	0,02
USD 456.876	Oakwood Mortgage Investors 5,26% 15/1/2019***	197.607	0,00	USD 1.400.000	Oracle 2,95% 1/4/2030	1.212.854	0,02
USD 379.929	Oakwood Mortgage Investors 6,93% 15/9/2031	203.837	0,00	USD 2.974.000	Oracle 4,9% 6/2/2033	2.841.708	0,04
USD 896.453	Oakwood Mortgage Investors 7,475% 15/8/2027	726.452	0,01	USD 2.115.000	Oracle 6,25% 9/11/2032	2.212.426	0,03
USD 28.148.566	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 0,511% 10/5/2039	357.003	0,01	USD 730.530	Oregon School Boards Association 4,759% 30/6/2028	719.019	0,01
USD 2.232.801	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 4,077% 10/5/2039	1.537.013	0,02	USD 1.910.000	Oregon School Boards Association 5,55% 30/6/2028	1.927.478	0,03
USD 1.142.000	Olympus Water US 7,125% 1/10/2027	1.068.567	0,01	EUR 1.200.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2,875% 30/4/2028*	1.158.526	0,02
EUR 2.656.000	Olympus Water US 9,625% 15/11/2028	2.886.572	0,04	USD 422.494	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A 7,82% 15/3/2032	404.503	0,01
USD 5.950.000	Olympus Water US 9,75% 15/11/2028	5.999.040	0,08	USD 555.314	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B 6,625% 15/10/2037	540.641	0,01
USD 1.800.000	Oncor Electric Delivery 2,75% 15/5/2030	1.556.243	0,02	USD 65.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	52.894	0,00
USD 1.585.000	Oncor Electric Delivery 4,3% 15/5/2028	1.535.602	0,02	USD 85.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	77.014	0,00
USD 2.200.000	Oncor Electric Delivery 4,6% 1/6/2052	1.962.735	0,03	USD 1.323.094	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 6,5% 25/1/2037	1.136.055	0,02
USD 2.340.000	Oncor Electric Delivery 5,75% 15/3/2029	2.409.720	0,03	USD 72.000	Pacific Gas and Electric 3,25% 16/2/2024	71.120	0,00
USD 41.869.799	One Market Plaza Trust 2017- 1MKT 0% 10/2/2032	1.407	0,00	USD 150.000	Pacific Gas and Electric 3,5% 1/8/2050	94.590	0,00
USD 8.776.000	One Market Plaza Trust 2017- 1MKT 0,218% 10/2/2032	22.908	0,00	USD 1.750.000	Pacific Gas and Electric 4,95% 1/7/2050	1.358.960	0,02
USD 1.989.000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3,14% 14/10/2036	1.825.493	0,03	USD 695.000	Pacific Gas and Electric 6,1% 15/1/2029	686.612	0,01
USD 3.870.000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 4,05% 14/10/2036	3.332.437	0,05	USD 641.000	Pacific Gas and Electric 6,4% 15/6/2033	634.439	0,01
USD 1.270.000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 2,76% 14/9/2035	1.104.148	0,02	USD 500.000	Palomino Funding Trust I 7,233% 17/5/2028	506.433	0,01
USD 3.210.000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 3,45% 14/9/2035	2.757.191	0,04	USD 3.206.000	Paramount Global 6,375% 30/3/2062	2.651.843	0,04
USD 450.000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2,22% 16/6/2036	376.850	0,01	USD 2.627.000	Park Intermediate / PK Domestic Property / PK Finance Co-Issuer 4,875% 15/5/2029	2.281.288	0,03
USD 3.831.000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 5,94% 16/6/2036	3.750.804	0,05	USD 3.060.000	Parker-Hannifin 3,25% 14/6/2029	2.765.215	0,04
USD 2.000.000	Option One Mortgage Loan Trust 2005-4 Asset-Backed Certificates Series 2005-4 6,164% 25/11/2035	1.639.517	0,02	USD 2.675.000	Parker-Hannifin 3,65% 15/6/2024	2.629.481	0,04
USD 1.950.000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 5,639% 25/3/2037	1.579.863	0,02	USD 78.000	PDC Energy 5,75% 15/5/2026	77.951	0,00
USD 4.573.183	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5,866% 25/1/2037	3.664.084	0,05	USD 1.500.000	PECO Energy 3% 15/9/2049	1.001.729	0,01
USD 4.919.337	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5,866% 25/1/2037	4.053.088	0,06	USD 1.350.000	PECO Energy 4,6% 15/5/2052	1.186.836	0,02
				USD 858.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	826.510	0,01
				USD 2.045.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 5,55% 1/5/2028	2.004.517	0,03
				USD 453.000	Periama 5,95% 19/4/2026	432.053	0,01
				USD 10.347.000	Permian Resources Operating 5,375% 15/1/2026	10.025.197	0,14
				USD 677.000	Permian Resources Operating 5,875% 1/7/2029	655.170	0,01
				USD 1.448.000	Permian Resources Operating 6,875% 1/4/2027	1.439.958	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 379.000	Permian Resources Operating 7,75% 15/2/2026	383.275	0,00	USD 1.000.000	Roper Technologies 3,8% 15/12/2026	954.102	0,01
USD 1.200.000	Pfizer 2,55% 28/5/2040	861.179	0,01	USD 1.070.000	Rutgers The State University of New Jersey 3,27% 1/5/2043	819.359	0,01
USD 1.860.000	Pfizer 2,625% 1/4/2030	1.636.220	0,02	USD 2.727.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	2.683.125	0,04
USD 2.622.000	Pilgrim's Pride 6,25% 1/7/2033	2.606.191	0,04	USD 466.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	459.531	0,01
USD 7.020.000	Pitney Bowes 6,875% 15/3/2027*	5.323.968	0,07	USD 1.889.000	Sabre GLBL 11,25% 15/12/2027	1.802.033	0,03
USD 1.650.000	PNC Financial Services 5,068% 24/1/2034	1.567.618	0,02	USD 2.345.000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052	2.525.628	0,04
USD 3.060.000	PNC Financial Services 5,939% 18/8/2034	3.093.594	0,04	USD 1.879.000	San Diego Gas & Electric 4,95% 15/8/2028	1.861.148	0,03
USD 1.300.000	PPG Industries 1,2% 15/3/2026	1.172.917	0,02	USD 1.800.000	Sanger Independent School District 4% 15/8/2047	1.668.804	0,02
USD 153.592	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 5,5% 25/5/2035	125.878	0,00	USD 372.000	Sasol Financing USA 4,375% 18/9/2026	333.370	0,00
USD 612.000	Prologis 2,25% 15/1/2032	491.528	0,01	USD 3.762.000	Sasol Financing USA 5,875% 27/3/2024*	3.721.954	0,05
USD 1.561.000	Prologis 4,625% 15/1/2033	1.498.328	0,02	USD 1.499.000	Sasol Financing USA 6,5% 27/9/2028	1.360.725	0,02
USD 1.853.000	Prologis 4,875% 15/6/2028	1.831.230	0,03	USD 2.750.000	Sasol Financing USA 8,75% 3/5/2029*	2.698.438	0,04
USD 2.912.637	PRPM 2020-4 2,951% 25/10/2025	2.865.011	0,04	EUR 1.446.000	SCIL IV / SCIL USA 9,5% 15/7/2028*	1.596.764	0,02
USD 550.000	Public Service Electric and Gas 4,65% 15/3/2033	533.358	0,01	USD 3.636.833	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0% 25/7/2056	383.608	0,01
USD 671.000	Rain Carbon 12,25% 1/9/2029	693.807	0,01	USD 4.545.646	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0,954% 25/7/2056	557.020	0,01
USD 569.907	RALI Series 2007-QH9 Trust 5,654% 25/11/2037	456.994	0,01	USD 485.780	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 3,326% 25/5/2057	186.639	0,00
USD 783.166	RAMP Series 2004-RS7 Trust 4,681% 25/7/2034	608.018	0,01	USD 170.000	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2006-OP1 6,434% 25/10/2035	124.158	0,00
USD 4.428.000	Rand Parent 8,5% 15/2/2030	4.227.253	0,06	USD 560.520	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2007-BR1 5,649% 25/2/2037	237.768	0,00
USD 2.733.088	RASC Series 2006-EMX9 Trust 5,909% 25/11/2036	2.168.244	0,03	USD 5.974.716	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2007-BR1 5,969% 25/2/2037	2.534.248	0,04
USD 17.796.697	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7,867% 25/10/2039	17.809.092	0,25	USD 6.005.000	Select Medical 6,25% 15/8/2026	5.952.742	0,08
USD 3.692.661	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 7,782% 25/6/2037	3.699.755	0,05	USD 1.401.000	Sempra 3,7% 1/4/2029	1.278.381	0,02
EUR 1.300.000	Realty Income 5,125% 6/7/2034	1.414.470	0,02	USD 892.000	Service Properties Trust 4,35% 1/10/2024	858.876	0,01
USD 2.635.000	Regal Rexnord 6,05% 15/2/2026	2.622.049	0,04	USD 857.000	Service Properties Trust 4,5% 15/3/2025	812.661	0,01
USD 61.953	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 5,829% 25/9/2035	53.125	0,00	USD 395.000	Service Properties Trust 5,5% 15/12/2027	349.904	0,00
USD 1.500.000	Republic Services 2,5% 15/8/2024	1.453.877	0,02	USD 2.337.000	Service Properties Trust 7,5% 15/9/2025	2.320.481	0,03
USD 750.000	Republic Services 2,9% 1/7/2026	704.898	0,01	USD 5.966.400	Sesac Finance 5,216% 25/7/2049	5.655.221	0,08
USD 750.000	Republic Services 3,375% 15/11/2027	697.183	0,01	USD 1.251.952	SG Mortgage Trust 2006-FRE2 5,749% 25/7/2036	264.526	0,00
USD 987.000	Republic Services 4,875% 1/4/2029	972.655	0,01	USD 1.000.000	Sherwin-Williams 3,45% 1/8/2025	962.561	0,01
USD 935.151	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 5,5% 25/5/2035	613.911	0,01	USD 360.000	Sherwin-Williams 3,95% 15/1/2026	348.346	0,00
USD 2.341.488	RFMSI Series 2006-SA2 Trust 5,341% 25/8/2036	1.663.315	0,02	USD 1.374.000	SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	1.038.277	0,01
USD 227.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	210.763	0,00	USD 395.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	364.747	0,01
USD 2.175.000	RingCentral 8,5% 15/8/2030	2.145.779	0,03	USD 217.000	Sirius XM Radio 5,5% 1/7/2029	195.743	0,00
USD 3.244.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	2.886.349	0,04	USD 5.917.263	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10,175% 15/10/2041	6.262.085	0,09
USD 3.312.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,625% 1/3/2029	2.825.763	0,04				
USD 710.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,875% 1/3/2031	575.936	0,01				
USD 1.000.000	Roper Technologies 2,95% 15/9/2029	883.247	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.485.000	SMB Private Education Loan Trust 2014-A 4,5% 15/9/2045	1.265.301	0,02	USD 1.155.000	State of California 7,3% 1/10/2039	1.367.401	0,02
USD 6.689.000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B 3,5% 17/12/2040	6.414.277	0,09	USD 630.000	State of California 7,35% 1/11/2039	749.359	0,01
USD 1.910.000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 3,5% 15/9/2043	1.831.307	0,03	USD 580.000	State of California 7,5% 1/4/2034	693.998	0,01
USD 1.800.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3% 15/8/2045	1.531.202	0,02	USD 1.300.000	State of California 7,55% 1/4/2039	1.597.187	0,02
USD 3.410.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2,5% 15/9/2054	2.699.169	0,04	USD 1.695.000	State of Georgia 4% 1/7/2040	1.722.468	0,02
USD 1.290.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 3,2% 15/9/2054	1.042.704	0,01	USD 1.695.000	State of Georgia 4% 1/7/2041	1.716.100	0,02
USD 3.600.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2,5% 15/9/2054	2.871.657	0,04	USD 1.885.000	State of Minnesota 4% 1/9/2038	1.920.096	0,03
USD 7.136.406	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2,99% 15/1/2053	5.937.297	0,08	USD 3.080.000	State of New York 2,8% 15/2/2032	2.660.069	0,04
USD 1.983.036	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3,86% 15/1/2053	1.794.996	0,02	USD 955.000	State of Ohio 5% 1/3/2039	1.041.684	0,01
USD 1.362.329	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3,86% 15/1/2053	1.224.447	0,02	USD 1.070.000	State of Oregon 5,892% 1/6/2027	1.089.815	0,02
USD 813.000	Sofi Professional Loan Program 2018-A 3,61% 25/2/2042	727.884	0,01	USD 4.564.000	State Street 6,552% 15/6/2047	3.729.226	0,05
USD 437.000	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 3,83% 25/8/2047	393.893	0,01	USD 3.000.000	Steel Dynamics 3,25% 15/10/2050	1.939.152	0,03
USD 248.000	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 4,14% 25/2/2048	221.409	0,00	USD 3.815.000	Steel Dynamics 3,45% 15/4/2030	3.386.744	0,05
USD 28.859	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 6,224% 25/1/2035	26.974	0,00	USD 297.000	Stem 0,5% 1/12/2028	181.332	0,00
EUR 9.787.000	Southern 1,875% 15/9/2081	8.422.642	0,12	USD 776.098	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3,875% 25/4/2036	468.182	0,01
USD 2.235.000	Southern California Edison 2,75% 1/2/2032	1.848.933	0,02	USD 542.510	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 5,889% 25/2/2036	463.544	0,01
USD 620.000	Southern California Edison 2,85% 1/8/2029	545.321	0,01	USD 276.900	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5 5,849% 25/5/2046	186.473	0,00
USD 1.650.000	Southern California Edison 3,65% 1/6/2051	1.180.382	0,02	USD 3.806.846	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 6% 25/10/2036	2.153.197	0,03
USD 1.900.000	Southern California Edison 4,7% 1/6/2027	1.867.529	0,03	USD 2.407.258	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF4 6% 25/10/2036	1.338.402	0,02
USD 1.000.000	Southern California Edison 5,3% 1/3/2028	1.002.786	0,01	USD 200.000	Summer BC Bidco B 5,5% 31/10/2026	173.778	0,00
USD 955.000	Southern California Edison 5,95% 1/11/2032	990.529	0,01	USD 760.000	Sumter Landing Community Development District 4,172% 1/10/2047	668.688	0,01
EUR 1.300.000	Southern Power 1,85% 20/6/2026*	1.333.598	0,02	USD 2.334.000	Sunoco / Sunoco Finance 4,5% 30/4/2030	2.081.791	0,03
USD 3.643.000	Spirit AeroSystems 7,5% 15/4/2025	3.600.042	0,05	USD 1.210.000	Sunoco / Sunoco Finance 5,875% 15/3/2028	1.172.723	0,02
USD 630.000	Spirit AeroSystems 9,375% 30/11/2029	656.195	0,01	USD 1.717.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	1.688.755	0,02
USD 6.489.000	Sprint 7,875% 15/9/2023	6.484.685	0,09	USD 424.000	TEGNA 4,625% 15/3/2028	380.761	0,01
USD 1.299.375	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4,738% 20/3/2025	1.286.179	0,02	USD 8.970.000	Tenet Healthcare 4,25% 1/6/2029	8.021.170	0,11
USD 356.250	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 5,152% 20/3/2028	353.084	0,01	USD 4.095.000	Tenet Healthcare 4,375% 15/1/2030	3.631.976	0,05
				USD 1.852.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	1.795.984	0,03
				USD 2.125.000	Tenneco 8% 17/11/2028	1.748.578	0,02
				USD 235.000	Tennessee Housing Development Agency 3,85% 1/7/2043	221.975	0,00
				USD 190.000	Tennessee Housing Development Agency 3,95% 1/1/2049	180.311	0,00
				USD 1.700.000	Texas A&M University 2,836% 15/5/2027	1.598.235	0,02
				USD 936.002	Thornburg Mortgage Trust 2006-3 3,58% 25/6/2046	630.282	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 29.577	Thornburg Mortgage Trust 2007-3 7,376% 25/6/2047	28.813	0,00	USD 33.173.100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,625% 15/10/2027*	33.486.284	0,46
USD 2.612.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	2.460.853	0,03	USD 46.479.100	United States Treasury Note/Bond 1,125% 15/2/2031*	37.734.312	0,52
USD 2.000.000	T-Mobile USA 1,5% 15/2/2026	1.821.693	0,03	USD 15.484.500	United States Treasury Note/Bond 1,125% 15/5/2040	9.594.341	0,13
USD 1.000.000	T-Mobile USA 2,05% 15/2/2028	872.523	0,01	USD 163.874.400	United States Treasury Note/Bond 1,25% 30/11/2026*	147.864.640	2,05
USD 1.750.000	T-Mobile USA 2,4% 15/3/2029	1.502.761	0,02	USD 46.464.500	United States Treasury Note/Bond 1,25% 31/12/2026*	41.867.056	0,58
USD 1.500.000	T-Mobile USA 2,7% 15/3/2032	1.221.702	0,02	USD 14.306.600	United States Treasury Note/Bond 1,375% 15/11/2031*	11.589.464	0,16
USD 1.500.000	T-Mobile USA 2,875% 15/2/2031	1.260.708	0,02	USD 8.589.500	United States Treasury Note/Bond 1,625% 15/11/2050	4.973.857	0,07
USD 5.415.000	T-Mobile USA 3,375% 15/4/2029	4.855.310	0,07	USD 20.159.800	United States Treasury Note/Bond 1,75% 15/8/2041†	13.555.891	0,19
USD 1.125.000	T-Mobile USA 3,5% 15/4/2031	982.694	0,01	USD 19.225.400	United States Treasury Note/Bond 1,875% 15/2/2041*	13.349.637	0,19
USD 1.700.000	T-Mobile USA 3,75% 15/4/2027	1.610.310	0,02	USD 7.385.700	United States Treasury Note/Bond 1,875% 15/2/2051	4.560.381	0,06
USD 4.290.000	T-Mobile USA 3,875% 15/4/2030	3.912.765	0,05	USD 10.043.200	United States Treasury Note/Bond 2,25% 15/8/2049*	6.837.222	0,09
USD 2.715.000	Tobacco Settlement Financing 6,706% 1/6/2046	2.323.839	0,03	USD 31.898.500	United States Treasury Note/Bond 2,375% 15/5/2029	28.870.634	0,40
USD 1.610.620	Topaz Solar Farms 5,75% 30/9/2039	1.524.444	0,02	USD 13.926.000	United States Treasury Note/Bond 2,375% 15/2/2042*	10.357.462	0,14
USD 555.000	Toyota Motor Credit 3,05% 22/3/2027	520.612	0,01	USD 14.761.300	United States Treasury Note/Bond 2,375% 15/11/2049	10.328.874	0,14
USD 2.085.000	Toyota Motor Credit 4,45% 18/5/2026	2.055.100	0,03	USD 107.318.600	United States Treasury Note/Bond 2,625% 31/5/2027*	100.627.956	1,39
USD 3.195.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	3.046.372	0,04	USD 19.130.800	United States Treasury Note/Bond 2,75% 31/7/2027	17.988.930	0,25
USD 167.000	Tri Pointe Homes 5,7% 15/6/2028	158.025	0,00	USD 10.379.800	United States Treasury Note/Bond 2,75% 15/8/2032	9.312.627	0,13
USD 850.000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4,564% 17/5/2037	819.657	0,01	USD 382.655.700	United States Treasury Note/Bond 2,875% 15/5/2032*	347.603.841	4,81
USD 580.000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4,96% 17/5/2037	561.360	0,01	USD 264.901.700	United States Treasury Note/Bond 2,875% 15/5/2052*	205.785.161	2,85
USD 1.550.000	Truist Financial 5,867% 8/6/2034*	1.537.056	0,02	USD 567.700	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2048	450.656	0,01
USD 2.675.000	Tyson Foods 3,95% 15/8/2024	2.627.315	0,04	USD 10.804.300	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2052*	8.617.695	0,12
USD 691.000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C12 4,788% 15/8/2051	585.746	0,01	USD 59.908.800	United States Treasury Note/Bond 3,125% 31/8/2027	57.105.256	0,79
EUR 1.381.000	UGI International 2,5% 1/12/2029*	1.172.172	0,02	USD 58.982.700	United States Treasury Note/Bond 3,25% 30/6/2027*	56.563.488	0,78
USD 132.000	United Rentals North America 5,5% 15/5/2027	129.515	0,00	USD 34.771.300	United States Treasury Note/Bond 3,25% 15/5/2042*	29.687.356	0,41
USD 1.378.000	United States Treasury Bill 0% 14/11/2023	1.363.083	0,02	USD 57.763.000	United States Treasury Note/Bond 4% 15/12/2025*	56.785.993	0,79
USD 13.020.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2026	14.197.699	0,20	USD 15.457.300	United States Treasury Note/Bond 4% 15/11/2052	14.924.748	0,21
USD 3.424.200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/10/2026	3.573.018	0,05	USD 1.632.000	United States Treasury Note/Bond 4,125% 15/8/2053	1.610.963	0,02
USD 8.076.300	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2027	8.063.068	0,11	USD 43.600.000	United States Treasury Note/Bond 4,25% 30/9/2024*	43.098.114	0,60
USD 105.415.900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,5% 15/4/2024*	124.776.243	1,73	USD 39.300	United States Treasury Note/Bond 4,625% 28/2/2025	39.007	0,00
USD 107.080.600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/1/2024*	138.119.562	1,91	USD 4.836.000	United Wholesale Mortgage 5,5% 15/11/2025	4.648.850	0,06
USD 35.904.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/7/2032	33.848.080	0,47	USD 2.010.000	UnitedHealth 2,3% 15/5/2031	1.680.534	0,02
USD 1.524.200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	1.407.869	0,02	USD 1.600.000	UnitedHealth 3,375% 15/4/2027	1.516.688	0,02
				USD 1.942.000	UnitedHealth 3,875% 15/12/2028	1.859.244	0,03
				USD 1.500.000	UnitedHealth 4,2% 15/5/2032	1.417.627	0,02
				USD 6.150.000	UnitedHealth 4,25% 15/1/2029	5.959.570	0,08
				USD 6.900.000	UnitedHealth 5,35% 15/2/2033	7.086.521	0,10

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.916.000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	2.906.386	0,04	USD 5.790.000	Vistra Operations 3,55% 15/7/2024	5.635.695	0,08
USD 1.095.000	University of California 5,77% 15/5/2043	1.150.350	0,02	USD 1.763.000	Vistra Operations 5% 31/7/2027	1.652.789	0,02
USD 1.279.909	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3,95% 15/11/2025	1.214.756	0,02	USD 1.750.000	Vistra Operations 5,125% 13/5/2025	1.705.769	0,02
USD 1.550.000	US Bancorp 5,836% 12/6/2034	1.548.464	0,02	USD 750.000	VMware 2,2% 15/8/2031	584.931	0,01
USD 656.540	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 4,24% 25/11/2047	527.189	0,01	USD 1.800.000	VMware 4,65% 15/5/2027	1.749.594	0,02
USD 109.684	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 5% 25/11/2047	84.831	0,00	USD 6.080.000	VMware 4,7% 15/5/2030	5.734.780	0,08
USD 111.795	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 4,26% 25/4/2048	97.910	0,00	USD 13.644.268	Voyager OPTONE Delaware Trust 7,495% 25/2/2038	3.269.575	0,05
USD 6.220.000	Venture Global LNG 8,125% 1/6/2028	6.268.970	0,09	USD 1.200.000	Walt Disney 1,75% 30/8/2024	1.156.157	0,02
GBP 1.000.000	Verizon Communications 1,125% 3/11/2028	1.003.396	0,01	USD 3.000.000	Walt Disney 2% 1/9/2029	2.545.643	0,04
EUR 372.000	Verizon Communications 1,125% 19/9/2035	283.832	0,00	USD 750.000	Walt Disney 3,8% 22/3/2030	702.501	0,01
USD 2.815.000	Verizon Communications 1,68% 30/10/2030	2.199.388	0,03	USD 4.188.154	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust 5,43% 25/2/2046	3.665.569	0,05
USD 2.600.000	Verizon Communications 2,1% 22/3/2028	2.269.900	0,03	USD 520.891	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR5 Trust 5,42% 25/6/2046	454.043	0,01
USD 1.500.000	Verizon Communications 2,355% 15/3/2032	1.186.559	0,02	USD 1.583.047	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 5,18% 25/6/2047	1.279.208	0,02
USD 4.195.000	Verizon Communications 2,55% 21/3/2031	3.451.968	0,05	USD 1.201.000	Warnermedia 6,412% 15/3/2026	1.202.923	0,02
USD 202.000	Verizon Communications 2,625% 15/8/2026	187.783	0,00	USD 5.500.000	Washington Health Care Facilities Authority 4% 1/10/2045	5.044.184	0,07
USD 2.250.000	Verizon Communications 3,15% 22/3/2030	1.973.141	0,03	USD 745.012	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5,5% 25/11/2035	511.912	0,01
USD 1.000.000	Verizon Communications 3,875% 8/2/2029	932.924	0,01	USD 304.629	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5,5% 25/11/2035	231.829	0,00
USD 375.000	Verizon Communications 4,016% 3/12/2029	348.069	0,01	USD 595.319	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust 6,5% 25/2/2036	478.247	0,01
GBP 264.000	Verizon Communications 4,073% 18/6/2024	330.242	0,00	USD 2.327.483	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6% 25/4/2036	2.071.585	0,03
USD 687.000	Verizon Communications 4,125% 16/3/2027	661.589	0,01	USD 196.460	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6,85% 25/5/2036	157.489	0,00
USD 2.500.000	Verizon Communications 4,5% 10/8/2033	2.310.435	0,03	USD 859.433	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 7% 25/5/2036	688.950	0,01
USD 290.000	Viasat 5,625% 15/9/2025	273.893	0,00	USD 3.998.951	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust 4,298% 25/10/2036	1.270.424	0,02
USD 1.736.000	Viasat 5,625% 15/4/2027	1.551.468	0,02	USD 1.972.862	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA3 Trust 5,68% 25/4/2047	1.668.042	0,02
USD 1.250.000	VICI Properties 4,95% 15/2/2030	1.176.919	0,02	USD 3.608.302	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 5,789% 25/9/2036	1.006.787	0,01
USD 3.625.000	VICI Properties / VICI Note 3,5% 15/2/2025	3.477.830	0,05	USD 4.291.274	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 4,162% 25/10/2036	3.179.053	0,04
USD 2.429.000	VICI Properties / VICI Note 3,75% 15/2/2027	2.230.077	0,03	USD 2.500.000	Waste Management 1,15% 15/3/2028	2.109.454	0,03
USD 850.000	VICI Properties / VICI Note 3,875% 15/2/2029	748.208	0,01				
USD 1.000.000	VICI Properties / VICI Note 4,125% 15/8/2030	875.988	0,01				
USD 1.858.000	VICI Properties / VICI Note 4,25% 1/12/2026	1.751.081	0,02				
USD 138.000	VICI Properties / VICI Note 4,5% 1/9/2026	130.745	0,00				
USD 1.633.000	VICI Properties / VICI Note 4,625% 1/12/2029	1.474.840	0,02				
USD 2.180.000	VICI Properties / VICI Note 5,625% 1/5/2024	2.164.913	0,03				
USD 207.000	VICI Properties / VICI Note 5,75% 1/2/2027	202.880	0,00				

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.290.000	Waste Management 2% 1/6/2029	1.093.008	0,01				
USD 3.090.000	Waste Management 4,875% 15/2/2034	3.014.988	0,04				
USD 921.000	Weekley Homes / Weekley Finance 4,875% 15/9/2028	815.123	0,01				
EUR 6.100.000	Wells Fargo 1,741% 4/5/2030	5.750.427	0,08				
USD 1.500.000	Wells Fargo 2,572% 11/2/2031	1.252.519	0,02				
GBP 2.400.000	Wells Fargo 3,473% 26/4/2028	2.734.796	0,04				
USD 2.602.000	Wells Fargo 4,808% 25/7/2028	2.523.374	0,04				
USD 2.897.000	Wells Fargo 5,574% 25/7/2029	2.883.105	0,04				
USD 572.513	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 4,224% 15/12/2048	528.319	0,01				
USD 2.633.561	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 1,389% 15/8/2049	79.453	0,00				
USD 448.469	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5,111% 15/1/2059	418.351	0,01				
USD 1.543.418	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5,144% 15/1/2059	1.364.733	0,02				
USD 830.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 4,188% 15/11/2050	679.367	0,01				
USD 960.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 4,002% 15/12/2050	795.766	0,01				
USD 896.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3,874% 15/6/2036	757.875	0,01				
USD 859.552	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 4,727% 15/6/2051	706.632	0,01				
USD 941.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C46 4,633% 15/8/2051	813.347	0,01				
USD 1.675.000	Welltower 2,05% 15/1/2029	1.404.227	0,02				
USD 3.615.000	Welltower 2,75% 15/1/2032	2.926.654	0,04				
USD 1.500.000	Welltower 4,25% 15/4/2028	1.418.921	0,02				
USD 496.178	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 4,204% 15/11/2047	460.728	0,01				
USD 1.711.001	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-3 3,978% 20/11/2044	1.521.498	0,02				
USD 3.949.291	WinWater Mortgage Loan Trust 2015-5 3,752% 20/8/2045	2.465.029	0,03				
USD 1.515.000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/11/2035	1.558.834	0,02				
EUR 603.000	WMG Acquisition 2,25% 15/8/2031	526.201	0,01				
USD 2.250.000	Workday 3,7% 1/4/2029	2.077.353	0,03				
USD 2.685.000	WRKCo 3,9% 1/6/2028	2.489.977	0,03				
USD 391.000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5,25% 15/5/2027	369.999	0,00				
USD 611.000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5,5% 1/3/2025	603.252	0,01				
USD 2.416.000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5,125% 1/10/2029	2.165.326	0,03				
USD 7.845.000	Xerox 5% 15/8/2025	7.487.150	0,10				
USD 808.000	XHR 4,875% 1/6/2029	699.868	0,01				
USD 699.000	XHR 6,375% 15/8/2025	691.061	0,01				
		3.741.465.951	51,79				
					Uruguay		
				USD 2.330.751	Uruguay Government International Bond 5,75% 28/10/2034*	2.503.821	0,03
					Total des obligations	6.272.948.921	86,83
					BILLET DE TRÉSORERIE		
					France		
				USD 6.454.000	Societe Generale 0% 6/3/2024	6.263.139	0,09
					Allemagne		
				USD 8.815.000	Bayer 0% 1/9/2023	8.812.329	0,12
					Suisse		
				USD 4.430.000	UBS (London Branch) 0% 18/6/2024	4.225.386	0,06
				USD 6.141.000	UBS (London Branch) 0% 25/6/2024	5.850.735	0,08
						10.076.121	0,14
					États-Unis		
				USD 8.549.000	3M 0% 7/9/2023	8.538.977	0,12
				USD 16.329.000	AT&T 0% 19/12/2023	16.045.190	0,22
				USD 2.880.000	AT&T 0% 20/12/2023	2.829.474	0,04
				USD 8.815.000	AT&T 0% 23/1/2024	8.611.584	0,12
				USD 22.620.000	AT&T 0% 21/2/2024	21.990.159	0,30
				USD 15.100.000	Crown Castle 0% 28/9/2023	15.028.951	0,21
				USD 3.680.000	Enel Finance America 0% 6/9/2023	3.676.097	0,05
				USD 5.585.000	General Motors 0% 22/1/2024	5.453.268	0,08
				USD 3.355.000	General Motors 0% 23/1/2024	3.275.307	0,04
				USD 6.924.000	General Motors 0% 25/1/2024	6.757.193	0,09
				USD 6.350.000	General Motors Financial 0% 10/10/2023	6.308.691	0,09
				USD 3.300.000	Global Payments 0% 25/9/2023	3.285.607	0,05
				USD 10.000.000	Harley-Davidson Bank 0% 22/9/2023	9.963.788	0,14
				USD 3.054.000	HSBC USA 0% 20/11/2023	3.015.239	0,04
				USD 3.000.000	HSBC USA 0% 24/6/2024	2.849.977	0,04
				USD 8.645.000	HSBC USA 0% 1/7/2024	8.201.901	0,11
				USD 4.340.000	HSBC USA 0% 12/8/2024	4.085.427	0,06
				USD 30.000.000	Ovintiv 0% 20/9/2023	29.898.395	0,41
				USD 28.500.000	Walgreens Boots Alliance 0% 2/10/2023	28.343.354	0,39
						188.158.579	2,60
					Total des billets de trésorerie	213.310.168	2,95
					CERTIFICATS DE DÉPÔT		
					États-Unis		
				USD 13.820.000	Citibank (New York Branch) 5% 21/9/2023	13.814.869	0,19
				USD 1.700.000	Mizuho Corporate Bank (New York Branch) 5,48% 4/1/2024	1.697.894	0,02
					Total des certificats de dépôt	15.512.763	0,21
					Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	6.616.843.954	91,58
					Autres titres négociables		
					ACTIONS ORDINAIRES / PRIVILEGIEES ET WARRANTS		
					Luxembourg		
				83.783	ADLER**	45.450	0,00
					États-Unis		
				97.804	Fanatics**	7.105.461	0,10
				110.969	Hawkeye 360 (Wts 7/7/2033)**	500.470	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
BRL	57.773.141	USD	11.668.590	Citigroup	14/9/2023	38.553
BRL	45.366.481	USD	9.218.671	Toronto-Dominion	20/9/2023	(34.601)
BRL	22.310.532	USD	4.533.500	Deutsche Bank	20/9/2023	(16.917)
BRL	36.284.242	USD	7.562.000	Barclays	5/9/2023	(198.580)
BRL	3.597.597	USD	730.000	BNP Paribas	5/9/2023	86
BRL	8.169.753	USD	1.657.655	Citigroup	20/9/2023	(3.756)
BRL	3.602.830	USD	721.000	JP Morgan	5/9/2023	10.148
BRL	7.008.000	USD	1.432.192	Barclays	14/9/2023	(12.091)
BRL	10.596.298	USD	2.155.954	JP Morgan	20/9/2023	(10.821)
BRL	22.949.434	USD	4.674.000	HSBC Bank	3/10/2023	(37.930)
BRL	14.076.804	USD	2.884.000	Citigroup	3/10/2023	(40.312)
CAD	1.869.846	USD	1.400.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(17.514)
CAD	5.652.775	USD	4.200.000	HSBC Bank	20/9/2023	(20.575)
CAD	5.438.852	USD	4.050.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(28.741)
CAD	2.798.008	USD	2.119.893	Bank of America	20/9/2023	(51.163)
CAD	3.325.880	USD	2.520.000	Citigroup	20/9/2023	(60.984)
CAD	7.395.610	USD	5.600.000	BNP Paribas	20/9/2023	(131.995)
CAD	1.646.542	USD	1.250.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(32.616)
CAD	7.503.666	USD	5.650.000	JP Morgan	20/9/2023	(102.102)
CAD	1.332.081	USD	1.000.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(15.116)
CAD	6.670.188	EUR	4.544.000	UBS	18/9/2023	(1.828)
CAD	1.959.562	USD	1.439.000	JP Morgan	18/9/2023	9.773
CAD	1.955.000	JPY	210.451.781	JP Morgan	15/9/2023	2.873
CHF	1.114.743	USD	1.250.000	Deutsche Bank	20/9/2023	14.346
CHF	3.036.312	USD	3.450.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(6.203)
CHF	1.631.695	USD	1.850.000	HSBC Bank	20/9/2023	675
CHF	7.399.000	USD	8.316.567	State Street	20/9/2023	75.410
CHF	1.108.132	USD	1.250.000	JP Morgan	20/9/2023	6.848
CHF	919.072	USD	1.050.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(7.587)
CHF	559.122	USD	650.000	BNP Paribas	20/9/2023	(15.842)
CHF	1.434.303	USD	1.650.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(23.207)
CHF	2.265.847	USD	2.600.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(30.068)
CLP	5.681.312.200	USD	6.528.000	Citigroup	15/9/2023	112.586
CLP	626.046.200	USD	722.000	BNP Paribas	15/9/2023	9.752
CLP	1.874.601.000	USD	2.162.170	BNP Paribas	14/9/2023	29.230
CLP	1.246.379.000	USD	1.440.235	Toronto-Dominion	14/9/2023	16.776
CLP	3.736.363.500	USD	4.317.000	Toronto-Dominion	15/9/2023	50.238
CLP	3.097.964.120	USD	3.598.000	JP Morgan	15/9/2023	23.045
CLP	1.246.379.000	USD	1.443.905	JP Morgan	14/9/2023	13.106
CLP	610.532.572	USD	722.000	Goldman Sachs	15/9/2023	(8.381)
CLP	618.688.800	USD	720.000	Barclays	15/9/2023	3.153
CNH	26.865.000	USD	3.802.655	Citigroup	14/9/2023	(108.140)
CNH	4.716.784	USD	661.204	Toronto-Dominion	20/9/2023	(12.343)
CNH	57.432.000	USD	8.049.738	Barclays	20/9/2023	(149.152)
CNH	53.455.000	USD	7.420.376	JP Morgan	14/9/2023	(69.163)
CNH	17.857.840	USD	2.496.919	BNP Paribas	21/9/2023	(40.193)
CNH	14.803.874	USD	2.084.759	Credit Agricole	20/9/2023	(48.276)
CNH	2.955.311	USD	416.241	JP Morgan	20/9/2023	(9.696)
CNH	5.456.157	USD	745.931	BNP Paribas	20/9/2023	4.641
CNH	4.243.414	USD	580.169	Bank of America	20/9/2023	3.573
COP	328.666.313	USD	76.608	Citigroup	20/9/2023	3.006
COP	21.011.368.736	USD	4.951.289	BNY Mellon	20/12/2023	23.432
COP	27.844.593.640	USD	6.542.433	BNY Mellon	14/9/2023	215.947
COP	20.562.934.000	USD	5.047.334	Standard Chartered Bank	14/9/2023	(56.344)
COP	13.082.574.000	GBP	2.586.000	Citigroup	18/9/2023	(107.216)
COP	28.729.637.000	USD	6.645.764	Morgan Stanley	15/8/2024	(115.942)
COP	14.885.798.000	USD	3.391.615	BNP Paribas	17/5/2024	36.419
COP	21.029.868.000	USD	5.076.000	Standard Chartered Bank	18/9/2023	21.511
COP	5.892.750.000	USD	1.432.017	Bank of America	14/9/2023	(1.741)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
COP	11.851.604.000	USD	2.878.000	Bank of America	18/9/2023	(5.244)
COP	11.883.994.000	USD	2.858.791	Toronto-Dominion	29/9/2023	11.204
COP	11.897.280.000	USD	2.880.000	Citigroup	18/9/2023	3.828
COP	5.950.210.000	USD	1.441.427	Citigroup	14/9/2023	2.795
CZK	70.522.709	USD	3.192.634	Barclays	14/9/2023	(13.316)
CZK	41.399.000	USD	1.892.963	Morgan Stanley	20/9/2023	(27.049)
CZK	151.942.231	USD	7.099.451	UBS	14/9/2023	(249.561)
CZK	148.584.925	USD	6.819.028	HSBC Bank	14/9/2023	(120.494)
CZK	28.700.188	USD	1.317.613	Morgan Stanley	6/9/2023	(23.335)
CZK	197.608.648	USD	8.936.000	Barclays	18/9/2023	(28.780)
EUR	15.342.303	USD	16.774.243	Deutsche Bank	20/9/2023	(115.787)
EUR	14.370.000	GBP	12.337.292	UBS	20/9/2023	(37.762)
EUR	20.111.000	GBP	17.310.916	Bank of America	20/9/2023	(109.538)
EUR	64.490.297	USD	70.884.907	JP Morgan	20/9/2023	(862.246)
EUR	6.702.000	GBP	5.771.825	JP Morgan	20/9/2023	(40.250)
EUR	54.934.676	USD	60.380.099	HSBC Bank	20/9/2023	(732.800)
EUR	19.129.313	USD	20.947.131	BNP Paribas	20/9/2023	(176.792)
EUR	1.865.856	USD	2.050.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(24.079)
EUR	1.787.000	SEK	20.977.950	UBS	20/9/2023	15.826
EUR	22.467.300	USD	24.755.065	Citigroup	20/9/2023	(360.386)
EUR	3.355.000	SEK	39.289.626	Morgan Stanley	20/9/2023	38.462
EUR	136.963	USD	150.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(1.287)
EUR	59.329.894	USD	66.865.705	Morgan Stanley	20/9/2023	(2.446.140)
EUR	2.800.000	USD	3.063.928	Société Générale	20/9/2023	(23.727)
EUR	5.580.000	GBP	4.782.395	HSBC Bank	20/9/2023	(4.159)
EUR	294.192	NOK	3.400.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(15)
EUR	2.487.778	SEK	29.290.891	Goldman Sachs	20/9/2023	14.108
EUR	286.387	NOK	3.200.000	Deutsche Bank	20/9/2023	10.301
EUR	2.501.000	USD	2.793.355	JP Morgan	21/9/2023	(77.673)
EUR	2.277.604	USD	2.500.000	Barclays	20/9/2023	(27.010)
EUR	5.006.317	AUD	8.156.492	Citibank	21/9/2023	149.364
EUR	6.664.000	USD	7.403.737	Citibank	14/9/2023	(170.161)
EUR	3.351.000	GBP	2.876.313	Goldman Sachs	20/9/2023	(7.955)
EUR	2.503.679	SEK	29.217.829	JP Morgan	20/9/2023	38.076
EUR	5.002.362	AUD	8.230.751	Morgan Stanley	20/9/2023	96.872
EUR	3.661.859	USD	3.984.566	Goldman Sachs	20/9/2023	(8.571)
EUR	2.501.000	USD	2.751.338	HSBC Bank	21/9/2023	(35.656)
EUR	91.286	USD	100.000	RBS	20/9/2023	(883)
EUR	268.828	HUF	106.000.000	Société Générale	20/9/2023	(9.516)
EUR	2.165.000	SEK	25.265.312	BNP Paribas	20/9/2023	32.939
EUR	1.049.420	USD	1.155.110	Bank of America	20/9/2023	(15.665)
EUR	1.665.867	AUD	2.789.357	Deutsche Bank	20/9/2023	901
EUR	2.498.801	AUD	4.191.848	Citigroup	20/9/2023	(3.713)
EUR	319.868	HUF	124.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(5.280)
EUR	1.112.000	PLN	4.963.896	HSBC Bank	18/9/2023	3.112
EUR	5.251.000	USD	5.725.092	Citigroup	18/9/2023	(24.182)
EUR	4.164.668	AUD	7.040.704	Bank of America	20/9/2023	(41.376)
EUR	3.343.000	USD	3.610.425	JP Morgan	18/9/2023	19.005
EUR	6.673.618	USD	7.237.753	State Street	20/9/2023	8.368
GBP	16.890.777	USD	21.777.229	JP Morgan	20/9/2023	(364.078)
GBP	19.520.025	EUR	22.700.000	HSBC Bank	20/9/2023	99.022
GBP	1.680.665	USD	2.144.480	Deutsche Bank	20/9/2023	(13.830)
GBP	1.826.225	USD	2.347.031	Morgan Stanley	20/9/2023	(31.849)
GBP	4.399.730	USD	5.655.399	HSBC Bank	20/9/2023	(77.676)
GBP	785.861	USD	1.000.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(3.731)
GBP	7.782.412	EUR	8.991.000	Deutsche Bank	20/9/2023	103.791
GBP	196.576	USD	250.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(792)
GBP	5.570.233	USD	7.135.699	BNP Paribas	20/9/2023	(74.079)
GBP	1.463.720	USD	1.877.361	Barclays	20/9/2023	(21.740)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
GBP	2.350.000	USD	3.010.741	JP Morgan	13/9/2023	(31.642)
GBP	2.885.340	EUR	3.351.000	JP Morgan	20/9/2023	19.399
GBP	118.472	USD	150.000	Commonwealth Bank of Australia	20/9/2023	191
GBP	7.218.321	EUR	8.370.000	Bank of America	20/9/2023	62.943
GBP	392.540	USD	500.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.360)
GBP	4.798.000	USD	6.071.342	JP Morgan	18/9/2023	11.230
HUF	3.403.377.863	USD	9.652.508	JP Morgan	14/9/2023	36.870
HUF	327.000.000	EUR	840.044	Deutsche Bank	20/9/2023	17.702
HUF	107.000.000	EUR	274.256	JP Morgan	20/9/2023	6.466
HUF	116.000.000	EUR	291.648	BNP Paribas	20/9/2023	13.174
HUF	1.109.825.402	USD	3.120.000	Deutsche Bank	18/9/2023	37.044
HUF	762.646.000	USD	2.159.920	Citigroup	14/9/2023	11.325
IDR	37.800.000.000	USD	2.532.154	Bank of America	20/9/2023	(50.727)
IDR	58.343.191.818	USD	3.927.253	UBS	20/9/2023	(97.242)
IDR	111.061.120.000	USD	7.409.014	JP Morgan	14/9/2023	(117.624)
IDR	54.600.000.000	USD	3.628.871	Barclays	20/9/2023	(44.587)
IDR	82.501.230.000	USD	5.394.000	Barclays	18/9/2023	22.054
IDR	65.504.582.120	USD	4.270.738	Barclays	26/9/2023	29.010
IDR	141.834.616.513	USD	9.251.492	Citigroup	20/9/2023	59.416
IDR	72.872.244.720	USD	4.763.203	HSBC Bank	14/9/2023	21.009
INR	764.250.000	USD	9.215.765	Barclays	20/9/2023	15.498
INR	1.408.575.000	USD	17.004.359	Citigroup	14/9/2023	9.846
INR	990.419.728	USD	12.001.000	Citigroup	20/9/2023	(37.866)
INR	297.501.000	USD	3.602.143	BNP Paribas	14/9/2023	(8.622)
INR	357.928.914	USD	4.326.000	Citigroup	18/9/2023	(2.610)
JPY	370.000.000	USD	2.596.284	Bank of America	20/9/2023	(58.232)
JPY	210.591.050	USD	1.500.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(55.430)
JPY	747.082.299	USD	5.263.915	BNP Paribas	20/9/2023	(139.229)
JPY	290.451.899	USD	2.075.676	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(83.291)
JPY	3.357.478.583	USD	24.109.950	Nomura	20/9/2023	(1.078.986)
JPY	311.077.360	USD	2.200.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(66.134)
JPY	3.688.482.709	USD	26.153.680	JP Morgan	20/9/2023	(852.157)
JPY	870.607.213	USD	6.320.608	Morgan Stanley	20/9/2023	(348.590)
JPY	42.750.000	USD	312.363	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(19.115)
JPY	228.765.222	USD	1.665.000	Citigroup	20/9/2023	(95.762)
JPY	186.463.888	USD	1.335.266	Citibank	20/9/2023	(56.198)
JPY	312.000.000	USD	2.181.500	HSBC Bank	20/9/2023	(41.304)
JPY	369.815.483	USD	2.600.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(63.213)
JPY	180.787.214	USD	1.250.000	Credit Agricole	20/9/2023	(9.872)
JPY	463.517.841	USD	3.204.000	HSBC Bank	15/9/2023	(26.995)
JPY	431.470.352	EUR	2.733.000	HSBC Bank	15/9/2023	(9.387)
JPY	209.931.555	CAD	1.955.000	JP Morgan	15/9/2023	(6.439)
JPY	209.284.551	USD	1.444.000	JP Morgan	15/9/2023	(9.539)
JPY	157.000.000	USD	1.079.592	Barclays	20/9/2023	(2.634)
KRW	431.369.450	USD	335.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(8.588)
KRW	4.816.725.000	USD	3.692.774	Citigroup	14/9/2023	(48.222)
KRW	3.932.931.600	USD	2.964.000	Citigroup	18/9/2023	11.948
MXN	1.070.000.737	USD	61.206.379	Barclays	20/9/2023	2.552.272
MXN	303.602.000	USD	17.427.928	Citigroup	20/9/2023	662.951
MXN	186.421.840	USD	11.001.779	JP Morgan	20/9/2023	106.629
MXN	14.565.602	USD	833.036	BNP Paribas	20/9/2023	34.892
MXN	7.696.314	USD	448.000	JP Morgan	18/9/2023	10.764
MXN	44.126.352	GBP	2.030.000	UBS	18/9/2023	56.799
MXN	50.139.484	USD	2.920.000	JP Morgan	15/9/2023	70.283
MXN	44.128.967	GBP	2.030.000	JP Morgan	18/9/2023	56.955
MXN	196.934	USD	11.443	State Street	14/9/2023	304
MXN	148.675.256	USD	8.759.000	Goldman Sachs	18/9/2023	103.265
MXN	22.434.706	USD	1.330.000	Toronto-Dominion	18/9/2023	7.292
MYR	13.314.334	USD	2.948.915	Barclays	14/9/2023	(77.383)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
MYR	27.193.320	USD	5.940.000	Barclays	18/9/2023	(73.468)
NOK	39.805.915	USD	3.620.146	Deutsche Bank	14/9/2023	119.077
NOK	81.443.836	USD	7.778.273	Morgan Stanley	20/9/2023	(126.283)
NOK	62.828.003	USD	5.965.445	HSBC Bank	20/9/2023	(62.490)
NOK	27.055.957	USD	2.530.008	Toronto-Dominion	20/9/2023	12.013
NOK	71.094.549	USD	6.748.145	Goldman Sachs	20/9/2023	(68.512)
NOK	1.460.000	USD	139.248	Citigroup	20/9/2023	(2.075)
NOK	147.186.200	USD	14.162.005	JP Morgan	20/9/2023	(333.243)
NOK	2.930.000	USD	274.530	Bank of America	20/9/2023	756
NOK	17.557.803	USD	1.710.550	BNP Paribas	20/9/2023	(60.921)
NOK	27.381.062	USD	2.652.603	Deutsche Bank	20/9/2023	(80.038)
NOK	6.600.000	EUR	561.403	Goldman Sachs	20/9/2023	10.534
NOK	1.180.000	USD	109.999	UBS	20/9/2023	867
NOK	1.310.000	USD	129.857	Barclays	20/9/2023	(6.777)
NOK	16.781.231	USD	1.668.612	Barclays	21/9/2023	(91.895)
NOK	16.905.388	USD	1.669.119	HSBC Bank	21/9/2023	(80.736)
NOK	960.000	USD	95.348	BNY Mellon	20/9/2023	(5.152)
NOK	5.154.259	USD	500.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(15.736)
NOK	1.600.000	USD	157.636	Société Générale	20/9/2023	(7.309)
NOK	30.564.233	USD	2.920.000	Deutsche Bank	15/9/2023	(48.816)
NOK	30.671.319	USD	2.884.000	Deutsche Bank	18/9/2023	(2.483)
NOK	15.315.673	USD	1.443.000	Goldman Sachs	18/9/2023	(4.119)
NOK	30.652.580	USD	2.878.000	JP Morgan	18/9/2023	1.756
NZD	3.187.248	USD	1.950.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(54.314)
NZD	4.951.684	USD	3.069.967	Toronto-Dominion	20/9/2023	(124.844)
NZD	3.364.000	USD	2.077.277	Bank of America	20/9/2023	(76.464)
NZD	8.055.255	USD	4.976.799	JP Morgan	20/9/2023	(185.758)
NZD	1.568.113	AUD	1.420.000	Deutsche Bank	20/9/2023	12.321
NZD	4.924.159	USD	2.982.563	BNP Paribas	20/9/2023	(53.811)
NZD	2.861.543	USD	1.700.000	Goldman Sachs	20/9/2023	1.966
NZD	1.473.854	USD	906.993	HSBC Bank	20/9/2023	(30.385)
NZD	6.132.838	USD	3.760.354	Morgan Stanley	20/9/2023	(112.714)
NZD	1.810.551	USD	1.100.000	UBS	20/9/2023	(23.135)
NZD	3.519.541	USD	2.100.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(6.676)
PLN	22.045.000	USD	5.289.742	Bank of America	14/9/2023	59.219
PLN	14.798.000	USD	3.618.680	Morgan Stanley	20/9/2023	(29.312)
PLN	9.050.011	USD	2.202.000	Citigroup	18/9/2023	(6.608)
SEK	54.628.651	USD	5.147.065	Deutsche Bank	20/9/2023	(135.546)
SEK	8.539.914	USD	800.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(16.566)
SEK	27.126.173	USD	2.567.109	Citigroup	20/9/2023	(78.608)
SEK	13.458.897	USD	1.267.669	Bank of America	20/9/2023	(32.978)
SEK	73.832.201	USD	6.865.325	Goldman Sachs	20/9/2023	(92.111)
SEK	29.530.196	USD	2.750.000	JP Morgan	20/9/2023	(40.961)
SEK	71.973.706	USD	6.772.057	Morgan Stanley	20/9/2023	(169.338)
SEK	39.037.524	USD	3.630.573	HSBC Bank	20/9/2023	(49.350)
SEK	36.269.864	USD	3.420.874	BNP Paribas	20/9/2023	(93.549)
SEK	7.860.000	USD	740.173	Barclays	20/9/2023	(19.113)
SEK	21.112.955	EUR	1.787.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(3.441)
SEK	1.630.000	USD	150.631	Société Générale	20/9/2023	(1.098)
SEK	19.158.427	USD	1.788.801	Toronto-Dominion	20/9/2023	(31.247)
SEK	45.048.803	EUR	3.842.500	JP Morgan	20/9/2023	(39.448)
SEK	1.620.000	USD	150.083	BNY Mellon	20/9/2023	(1.468)
SEK	29.657.807	EUR	2.487.778	BNP Paribas	20/9/2023	19.552
SEK	3.050.000	USD	298.187	State Street	20/9/2023	(18.386)
SEK	19.292.089	EUR	1.677.500	UBS	20/9/2023	(51.589)
SEK	28.918.619	EUR	2.503.679	HSBC Bank	20/9/2023	(65.525)
SEK	3.747.114	USD	350.000	UBS	20/9/2023	(6.248)
SEK	1.820.000	USD	166.749	RBS	20/9/2023	214
SEK	31.235.328	USD	2.880.000	UBS	18/9/2023	(14.818)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
SGD	5.094.467	USD	3.794.220	JP Morgan	14/9/2023	(23.614)
THB	268.292.620	USD	7.767.592	HSBC Bank	14/9/2023	(98.314)
THB	258.460.000	USD	7.495.118	Citigroup	14/9/2023	(106.911)
THB	252.700.000	USD	7.290.301	Citigroup	20/9/2023	(62.447)
THB	312.728.884	USD	8.873.000	Goldman Sachs	18/9/2023	70.058
TWD	58.700.000	USD	1.888.917	Citigroup	20/9/2023	(45.393)
USD	2.095.450	EUR	1.954.000	RBS	20/9/2023	(26.176)
USD	7.608.394	CZK	167.850.445	Barclays	6/9/2023	38.928
USD	46.236.563	EUR	42.442.259	HSBC Bank	20/9/2023	153.357
USD	14.123.652	EUR	12.778.000	Standard Chartered Bank	20/9/2023	249.480
USD	15.990.071	IDR	238.567.858.000	Citigroup	20/9/2023	328.990
USD	1.929.081	TWD	58.700.000	Barclays	20/9/2023	85.556
USD	9.124.995	IDR	135.832.845.842	UBS	14/9/2023	207.291
USD	7.022.324	CZK	155.719.486	Deutsche Bank	14/9/2023	2.148
USD	30.886.118	MXN	546.187.018	JP Morgan	14/9/2023	(1.693.743)
USD	10.838.753	ZAR	209.193.816	Goldman Sachs	14/9/2023	(284.698)
USD	3.279.650	EUR	3.015.339	Royal Bank of Canada	20/9/2023	5.636
USD	4.860.062	GBP	3.826.157	Toronto-Dominion	20/9/2023	9.481
USD	14.544.727	COP	61.421.675.915	Citigroup	14/9/2023	(363.410)
USD	14.077.648	EUR	12.978.100	State Street	20/9/2023	(13.790)
USD	2.740.517	EUR	2.531.952	State Street	14/9/2023	(7.842)
USD	553.070	EUR	509.698	BNY Mellon	14/9/2023	(192)
USD	5.028.919	NOK	52.134.120	Deutsche Bank	20/9/2023	130.699
USD	16.075.632	GBP	12.508.185	JP Morgan	20/9/2023	218.476
USD	1.800.000	GBP	1.421.429	Deutsche Bank	20/9/2023	(2.005)
USD	2.150.000	CAD	2.848.618	Deutsche Bank	20/9/2023	43.851
USD	6.338.648	KRW	8.000.000.000	State Street	20/9/2023	285.138
USD	1.050.000	AUD	1.542.418	Deutsche Bank	20/9/2023	50.308
USD	10.687.098	MXN	186.421.840	JP Morgan	20/9/2023	(421.310)
USD	1.000.000	JPY	141.261.612	Goldman Sachs	20/9/2023	31.002
USD	3.250.000	NZD	5.354.161	Goldman Sachs	20/9/2023	65.494
USD	1.900.000	EUR	1.735.633	Morgan Stanley	20/9/2023	15.474
USD	600.000	CHF	534.276	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(5.979)
USD	2.344.094	SEK	25.145.763	Deutsche Bank	20/9/2023	37.274
USD	5.459.592	SEK	57.950.000	Bank of America	20/9/2023	143.379
USD	1.818.173	EUR	1.666.367	Citigroup	14/9/2023	9.380
USD	3.975.687	GBP	3.129.000	Bank of America	20/9/2023	8.921
USD	4.498.435	SEK	48.545.314	Goldman Sachs	20/9/2023	44.987
USD	8.278.821	NOK	85.737.583	Morgan Stanley	20/9/2023	223.414
USD	16.992.607	CNH	120.869.011	Toronto-Dominion	20/9/2023	365.360
USD	250.000	GBP	195.939	Royal Bank of Canada	20/9/2023	1.599
USD	499.054.608	EUR	454.765.776	Toronto-Dominion	20/9/2023	5.276.326
USD	6.083.988	AUD	9.141.057	Royal Bank of Canada	20/9/2023	159.366
USD	32.892.110	MXN	568.434.096	Goldman Sachs	20/9/2023	(979.447)
USD	600.000	CAD	802.949	Royal Bank of Canada	20/9/2023	6.333
USD	1.646.018	SEK	17.623.544	BNP Paribas	20/9/2023	29.269
USD	2.700.000	NOK	28.596.553	Royal Bank of Canada	20/9/2023	13.234
USD	14.075.534	JPY	1.963.140.000	BNY Mellon	20/9/2023	609.176
USD	525.085	CAD	692.000	BNY Mellon	20/9/2023	13.449
USD	6.237.079	SEK	66.191.748	Morgan Stanley	20/9/2023	164.784
USD	4.696.682	AUD	6.830.000	BNY Mellon	20/9/2023	269.933
USD	2.320.244	AUD	3.364.000	Nomura	20/9/2023	139.924
USD	500.000	GBP	389.123	Nomura	20/9/2023	6.693
USD	2.073.928	GBP	1.628.054	Morgan Stanley	20/9/2023	9.976
USD	8.278.058	CAD	11.047.038	Morgan Stanley	20/9/2023	110.341
USD	4.190.855	NZD	6.725.000	Nomura	20/9/2023	191.014
USD	1.250.000	AUD	1.812.955	Citigroup	20/9/2023	74.964
USD	872.513.088	EUR	795.060.244	BNP Paribas	20/9/2023	9.247.858
USD	1.242.818	AUD	1.810.000	Bank of America	20/9/2023	69.697

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	433.156.204	GBP	337.805.450	BNP Paribas	20/9/2023	4.905.957
USD	3.269.364	JPY	465.476.290	Bank of America	20/9/2023	76.381
USD	1.862.702	EUR	1.695.739	Bank of America	22/9/2023	21.315
USD	52.462.632	EUR	47.413.741	JP Morgan	20/9/2023	981.460
USD	4.383.937	HKD	34.238.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	15.094
USD	785.081	EUR	714.691	Deutsche Bank	22/9/2023	9.005
USD	2.462.106	SGD	3.297.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	21.208
USD	13.207.215	AUD	20.013.254	JP Morgan	20/9/2023	235.963
USD	617.632	GBP	484.000	RBS	20/9/2023	4.045
USD	3.150.000	CHF	2.785.473	Goldman Sachs	20/9/2023	(9.295)
USD	6.700.000	CAD	8.876.469	JP Morgan	20/9/2023	137.111
USD	146.694	NOK	1.570.000	RBS	20/9/2023	(814)
USD	600.000	CHF	533.260	HSBC Bank	20/9/2023	(4.825)
USD	11.141.353	NOK	117.603.280	JP Morgan	20/9/2023	92.030
USD	1.843.361	NOK	19.559.268	HSBC Bank	20/9/2023	5.686
USD	439.554	EUR	400.332	Citigroup	22/9/2023	4.837
USD	3.414.037	SEK	36.464.710	Citigroup	20/9/2023	68.839
USD	1.303.731	NZD	2.107.034	HSBC Bank	20/9/2023	50.526
USD	3.827.697	JPY	548.862.380	HSBC Bank	20/9/2023	62.720
USD	25.887.652	BRL	124.825.733	Goldman Sachs	20/9/2023	617.710
USD	14.841.611	MXN	258.592.809	Citigroup	20/9/2023	(567.284)
USD	6.977.371	SEK	73.759.738	JP Morgan	20/9/2023	210.806
USD	12.308.053	IDR	184.313.096.232	Citigroup	26/9/2023	209.665
USD	4.610.000	CAD	6.078.943	HSBC Bank	20/9/2023	115.483
USD	13.932.031	ZAR	265.289.422	Citigroup	14/9/2023	(174.189)
USD	13.416.136	JPY	1.905.489.415	JP Morgan	20/9/2023	345.236
USD	13.101.803	EUR	11.943.825	Deutsche Bank	20/9/2023	133.366
USD	2.850.000	NZD	4.747.946	Royal Bank of Canada	20/9/2023	26.054
USD	1.626.211	JPY	229.273.098	Royal Bank of Canada	20/9/2023	53.488
USD	2.304.155	AUD	3.466.350	BNP Paribas	20/9/2023	57.498
USD	550.000	CHF	485.705	BNP Paribas	20/9/2023	(888)
USD	1.100.000	CAD	1.452.473	BNP Paribas	20/9/2023	26.103
USD	600.000	NZD	979.761	Citigroup	20/9/2023	17.265
USD	2.381.615	NOK	24.414.668	Barclays	20/9/2023	87.755
USD	4.943.438	EUR	4.520.000	Société Générale	20/9/2023	35.686
USD	18.623.273	COP	81.025.204.449	Bank of America	20/12/2023	(560.520)
USD	4.100.000	NZD	6.666.638	JP Morgan	20/9/2023	134.870
USD	2.130.418	GBP	1.674.000	State Street	20/9/2023	8.218
USD	1.052.748	HKD	8.230.000	UBS	20/9/2023	2.583
USD	2.996.887	GBP	2.350.000	JP Morgan	13/9/2023	17.787
USD	3.773.805	SGD	5.094.467	Citigroup	14/9/2023	3.199
USD	3.791.455	NOK	39.204.760	Goldman Sachs	20/9/2023	108.004
USD	15.672.988	INR	1.289.260.000	Barclays	14/9/2023	99.990
USD	900.000	CHF	791.213	Deutsche Bank	20/9/2023	2.604
USD	900.000	NZD	1.469.594	Toronto-Dominion	20/9/2023	25.927
USD	1.300.000	CAD	1.730.605	Toronto-Dominion	20/9/2023	20.464
USD	5.008.446	EUR	4.583.561	UBS	20/9/2023	31.680
USD	750.000	JPY	107.123.565	Toronto-Dominion	20/9/2023	15.175
USD	4.169.965	GBP	3.279.769	Standard Chartered Bank	20/9/2023	12.063
USD	300.000	JPY	42.769.020	RBS	20/9/2023	6.622
USD	820.135	NOK	8.627.715	Bank of America	20/9/2023	9.524
USD	2.688.726	IDR	40.376.598.000	HSBC Bank	20/9/2023	38.155
USD	7.290.102	SGD	9.820.000	Morgan Stanley	20/9/2023	19.974
USD	1.934.191	INR	159.300.000	Goldman Sachs	20/9/2023	10.030
USD	1.264.772	GBP	990.000	Barclays	20/9/2023	9.707
USD	1.400.000	NOK	14.321.504	Toronto-Dominion	20/9/2023	54.435
USD	550.000	CHF	486.480	Toronto-Dominion	20/9/2023	(1.768)
USD	850.000	AUD	1.271.743	Toronto-Dominion	20/9/2023	25.741
USD	4.721.000	TWD	146.870.310	BNP Paribas	11/10/2023	104.850

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	2.573.285	GBP	2.007.502	HSBC Bank	20/9/2023	28.289
USD	5.793.892	JPY	824.837.990	Barclays	20/9/2023	135.832
USD	17.649.251	EUR	16.240.979	Barclays	20/9/2023	15.024
USD	965.013	SEK	10.246.454	Barclays	20/9/2023	25.025
USD	15.901.996	JPY	2.304.520.337	Citigroup	20/9/2023	93.906
USD	5.584.591	JPY	782.374.456	BNP Paribas	20/9/2023	217.815
USD	25.903.396	EUR	23.435.467	Citigroup	20/9/2023	464.548
USD	1.461.130	SEK	15.587.087	UBS	20/9/2023	31.202
USD	2.850.000	CHF	2.484.674	JP Morgan	20/9/2023	31.872
USD	200.000	NZD	322.832	Deutsche Bank	20/9/2023	7.988
USD	2.496.919	CNH	17.820.012	Citigroup	21/9/2023	45.397
USD	2.702.310	PHP	148.600.000	Deutsche Bank	20/9/2023	78.870
USD	335.000	KRW	427.099.540	Morgan Stanley	20/9/2023	11.819
USD	670.000	JPY	92.504.735	Deutsche Bank	20/9/2023	35.454
USD	2.629.909	NZD	4.315.679	Morgan Stanley	20/9/2023	63.064
USD	348.155	SEK	3.610.000	State Street	20/9/2023	16.980
USD	152.794	NOK	1.530.000	BNY Mellon	20/9/2023	9.044
USD	94.865	SEK	970.000	BNY Mellon	20/9/2023	5.880
USD	1.746.459	SEK	17.786.329	Toronto-Dominion	20/9/2023	114.778
USD	1.237.133	EUR	1.099.000	Royal Bank of Canada	22/9/2023	43.739
USD	1.350.000	CHF	1.169.599	Morgan Stanley	20/9/2023	23.436
USD	151.941	NOK	1.520.000	State Street	20/9/2023	9.131
USD	4.453.686	AUD	6.609.504	HSBC Bank	20/9/2023	169.847
USD	600.000	NZD	962.882	BNP Paribas	20/9/2023	27.304
USD	3.951.657	NOK	39.805.915	Barclays	14/9/2023	212.435
USD	2.501.000	CNH	17.835.431	BNP Paribas	20/9/2023	47.483
USD	14.987.677	MXN	257.001.191	HSBC Bank	20/9/2023	(326.377)
USD	12.358.593	CZK	271.444.614	Barclays	14/9/2023	121.275
USD	3.803.340	EUR	3.449.373	BNY Mellon	20/9/2023	58.060
USD	4.348.792	HUF	1.522.647.000	Bank of America	14/9/2023	13.834
USD	3.229.424	GBP	2.501.000	Citibank	20/9/2023	58.800
USD	582.178	EUR	523.924	Morgan Stanley	14/9/2023	13.474
USD	136.598	EUR	122.880	Standard Chartered Bank	22/9/2023	3.165
USD	14.821.774	BRL	72.483.956	BNY Mellon	14/9/2023	133.632
USD	1.668.612	NOK	16.665.336	Morgan Stanley	21/9/2023	102.784
USD	700.000	GBP	548.042	Goldman Sachs	20/9/2023	5.225
USD	3.702.165	EUR	3.400.914	Goldman Sachs	20/9/2023	9.500
USD	2.600.000	CAD	3.480.345	Goldman Sachs	20/9/2023	26.779
USD	1.132.597	NOK	11.840.528	BNP Paribas	20/9/2023	20.130
USD	14.733.707	IDR	224.049.787.270	Morgan Stanley	20/9/2023	25.683
USD	5.521.808	EUR	5.002.000	Citigroup	21/9/2023	90.444
USD	4.388.547	IDR	66.903.406.000	Citigroup	14/9/2023	(3.798)
USD	5.761.431	MXN	99.887.000	Citigroup	14/9/2023	(196.792)
USD	400.000	CHF	348.650	UBS	20/9/2023	4.560
USD	589.053	NOK	6.032.357	UBS	20/9/2023	22.288
USD	1.450.000	AUD	2.206.488	Goldman Sachs	20/9/2023	19.902
USD	5.124.373	PLN	20.945.000	JP Morgan	14/9/2023	42.315
USD	3.615.715	BRL	17.670.000	Goldman Sachs	14/9/2023	35.068
USD	1.669.119	NOK	17.049.633	JP Morgan	21/9/2023	67.184
USD	500.000	JPY	70.673.650	UBS	20/9/2023	15.207
USD	500.000	GBP	393.760	UBS	20/9/2023	813
USD	150.000	CAD	200.388	UBS	20/9/2023	1.842
USD	3.421.220	EUR	3.112.735	UBS	7/11/2023	33.353
USD	9.967.204	ZAR	188.016.429	State Street	7/11/2023	18.602
USD	7.136.725	MXN	121.840.565	Barclays	14/9/2023	(131.021)
USD	833.036	MXN	14.409.893	BNP Paribas	20/9/2023	(25.613)
USD	1.050.000	JPY	152.460.392	Morgan Stanley	20/9/2023	4.182
USD	420.711	CZK	9.332.135	UBS	6/9/2023	(135)
USD	1.256.683	COP	5.315.768.395	Citigroup	20/12/2023	(1.896)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	730.000	COP	2.996.956.600	Barclays	18/9/2023	3.556
USD	300.000	CAD	402.786	Citigroup	20/9/2023	2.197
USD	1.462.122	AUD	2.234.006	Morgan Stanley	20/9/2023	14.189
USD	5.244.000	COP	21.070.104.000	Citigroup	18/9/2023	136.735
USD	6.547.598	CNH	47.468.000	Citigroup	14/9/2023	19.726
USD	2.800.000	CHF	2.446.580	Barclays	20/9/2023	25.079
USD	6.292.403	AUD	9.681.132	Barclays	20/9/2023	17.741
USD	730.000	BRL	3.575.007	Goldman Sachs	5/9/2023	4.498
USD	5.965.512	BRL	29.083.581	Citigroup	20/9/2023	77.781
USD	7.139.572	COP	28.729.637.000	Morgan Stanley	15/9/2023	168.712
USD	2.920.000	CLP	2.492.512.000	BNP Paribas	15/9/2023	6.635
USD	1.032.000	CLP	880.605.600	Morgan Stanley	15/9/2023	2.706
USD	2.008.000	ZAR	38.471.774	Morgan Stanley	18/9/2023	(36.937)
USD	4.380.000	CNH	31.812.896	Goldman Sachs	18/9/2023	4.138
USD	627.914	AUD	970.000	Citigroup	18/9/2023	(729)
USD	3.188.000	CAD	4.292.732	Deutsche Bank	18/9/2023	14.232
USD	2.271.000	JPY	328.542.140	HSBC Bank	15/9/2023	19.134
USD	2.920.000	NOK	30.620.673	Deutsche Bank	15/9/2023	43.514
USD	3.616.333	EUR	3.305.000	Goldman Sachs	14/9/2023	28.853
USD	3.619.386	CNH	26.315.000	JP Morgan	14/9/2023	507
USD	2.202.000	PLN	9.006.323	HSBC Bank	18/9/2023	17.206
USD	10.199.000	MXN	174.303.624	JP Morgan	18/9/2023	(190.926)
USD	2.920.000	MXN	50.238.573	JP Morgan	15/9/2023	(76.193)
USD	4.374.000	JPY	636.770.784	JP Morgan	15/9/2023	9.498
USD	730.000	ZAR	14.046.300	Goldman Sachs	18/9/2023	(16.620)
USD	2.902.000	MXN	50.108.834	Citigroup	18/9/2023	(84.898)
USD	2.902.000	COP	11.999.770.000	Standard Chartered Bank	18/9/2023	(6.672)
USD	3.166.563	GBP	2.486.000	Citigroup	20/9/2023	14.956
USD	3.562.048	COP	14.885.798.000	BNP Paribas	17/10/2023	(14.804)
USD	2.174.462	AUD	3.353.000	JP Morgan	18/9/2023	1.431
USD	112.575	NOK	1.180.000	Citigroup	20/9/2023	1.709
USD	2.898.000	THB	102.647.160	BNP Paribas	18/9/2023	(37.384)
USD	2.174.141	THB	77.032.000	BNP Paribas	14/9/2023	(27.857)
USD	2.411.297	IDR	36.970.000.000	Barclays	20/9/2023	(15.644)
USD	4.332.900	GBP	3.410.000	JP Morgan	18/9/2023	9.938
USD	4.211.404	AUD	6.564.000	Deutsche Bank	18/9/2023	(42.630)
USD	950.000	SEK	10.396.038	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(3.712)
USD	950.000	SEK	10.379.282	HSBC Bank	20/9/2023	(2.174)
USD	2.163.000	ZAR	40.524.232	Barclays	18/9/2023	8.966
USD	721.000	BRL	3.565.828	JP Morgan	5/9/2023	(2.639)
USD	3.608.000	NOK	38.550.956	Goldman Sachs	18/9/2023	(13.795)
USD	662.435	CNH	4.818.376	JP Morgan	20/9/2023	(401)
USD	2.880.000	ZAR	53.413.473	Citigroup	18/9/2023	40.849
USD	1.439.000	CAD	1.948.862	JP Morgan	18/9/2023	(1.863)
USD	2.883.000	CLP	2.482.263.000	Toronto-Dominion	15/9/2023	(18.386)
USD	83.072.171	MXN	1.404.359.970	Barclays	28/9/2023	(493.701)
USD	5.755.000	MXN	97.115.067	Goldman Sachs	18/9/2023	(33.855)
USD	2.877.283	BRL	14.082.000	Citigroup	14/9/2023	23.708
USD	2.888.000	BRL	14.113.656	Citigroup	5/9/2023	23.816
USD	2.158.000	ZAR	40.224.967	UBS	18/9/2023	19.874
USD	720.000	ZAR	13.395.975	HSBC Bank	18/9/2023	7.948
USD	1.445.000	ZAR	26.959.986	JP Morgan	18/9/2023	11.963
USD	4.674.000	BRL	22.847.680	HSBC Bank	5/9/2023	37.358
USD	170.183	SEK	1.870.000	RBS	20/9/2023	(1.367)
USD	1.441.776	EUR	1.330.000	Goldman Sachs	18/9/2023	(2.180)
USD	1.477.395	NZD	2.482.898	Bank of America	20/9/2023	637
USD	1.316.103	EUR	1.208.000	Morgan Stanley	18/9/2023	4.601
USD	4.326.000	CNH	31.552.546	Citigroup	18/9/2023	(14.052)
USD	879.656	EUR	805.000	Barclays	18/9/2023	5.683

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	721.000	NOK	7.603.984	Morgan Stanley	18/9/2023	6.619
USD	7.126.327	COP	29.227.203.255	BNY Mellon	14/9/2023	32.363
ZAR	152.104.927	USD	8.178.036	Barclays	20/9/2023	(94.444)
ZAR	31.016.000	USD	1.678.097	Morgan Stanley	20/9/2023	(29.757)
ZAR	65.844.000	USD	3.655.238	HSBC Bank	14/9/2023	(154.119)
ZAR	122.301.000	USD	6.479.480	Citigroup	14/9/2023	23.625
ZAR	60.950.504	EUR	2.916.000	Morgan Stanley	18/9/2023	73.930
ZAR	27.811.158	USD	1.452.000	Morgan Stanley	18/9/2023	26.280
ZAR	188.016.429	USD	9.781.587	Morgan Stanley	7/11/2023	167.016
ZAR	13.723.665	USD	721.000	Barclays	18/9/2023	8.471
ZAR	26.927.712	USD	1.440.000	BNP Paribas	18/9/2023	(8.679)
ZAR	53.849.106	USD	2.878.000	Bank of America	18/9/2023	(15.694)
ZAR	81.239.105	USD	4.323.000	UBS	18/9/2023	(4.800)
ZAR	40.429.757	USD	2.160.000	JP Morgan	18/9/2023	(10.988)
Plus-value nette non réalisée						15.185.830
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	87.105.221	USD	56.731.082	BNY Mellon	15/9/2023	(285.569)
USD	633.805	AUD	988.462	BNY Mellon	15/9/2023	(6.730)
Moins-value nette non réalisée						(292.299)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	1.059.986.695	USD	788.234.805	BNY Mellon	15/9/2023	(4.584.516)
USD	19.637.523	CAD	26.589.915	BNY Mellon	15/9/2023	(20.430)
Moins-value nette non réalisée						(4.604.946)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	185.311.568	USD	212.198.182	BNY Mellon	15/9/2023	(2.128.544)
USD	9.752.888	CHF	8.534.739	BNY Mellon	15/9/2023	77.912
Moins-value nette non réalisée						(2.050.632)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	26.627	USD	3.690	BNY Mellon	15/9/2023	(28)
USD	44	CNY	319	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(28)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	971.677.240	USD	1.066.198.069	BNY Mellon	15/9/2023	(11.413.806)
USD	13.028.942	EUR	11.938.417	BNY Mellon	15/9/2023	69.475
Moins-value nette non réalisée						(11.344.331)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	247.304.027	USD	314.648.586	BNY Mellon	15/9/2023	(1.137.896)
USD	15.360.138	GBP	12.080.053	BNY Mellon	15/9/2023	46.093
Moins-value nette non réalisée						(1.091.803)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	2.947.401	USD	377.658	BNY Mellon	15/9/2023	(1.654)
USD	2.270	HKD	17.766	BNY Mellon	15/9/2023	4
Moins-value nette non réalisée						(1.650)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	50.985.523.133	USD	357.896.541	BNY Mellon	15/9/2023	(8.420.952)
USD	10.396.919	JPY	1.503.266.884	BNY Mellon	15/9/2023	93.188
Moins-value nette non réalisée						(8.327.764)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	91.433.875	USD	22.500.152	BNY Mellon	15/9/2023	(316.216)
USD	557.248	PLN	2.285.505	BNY Mellon	15/9/2023	2.729
Moins-value nette non réalisée						(313.487)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	4.570.399	USD	427.799	BNY Mellon	15/9/2023	(8.620)
USD	74.041	SEK	811.115	BNY Mellon	15/9/2023	(350)
Moins-value nette non réalisée						(8.970)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	685.907	SGD	928.588	BNY Mellon	5/9/2023	(1.096)
SGD	114.748.575	USD	85.243.134	BNY Mellon	15/9/2023	(309.404)
USD	653.850	SGD	887.456	BNY Mellon	15/9/2023	(3.018)
Moins-value nette non réalisée						(313.518)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 7.434.242.227)						(13.163.598)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
40	USD	30 Day Federal Funds	Août 2023	15.779.596	(10.001)
(88)	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	11.077.985	(52.826)
931	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	134.341.172	496.762
(128)	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	18.533.989	375.760
(471)	EUR	Euro Schatz	Septembre 2023	53.704.512	25.605
(723)	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	90.921.589	(358.035)
44	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	6.096.568	(49.117)
(111)	JPY	Nikkei 225 Index	Septembre 2023	12.400.211	(52.249)
86	JPY	TOPIX Index	Septembre 2023	13.745.410	564.880
(247)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	248.343.587	1.006.482
343	AUD	Australian 10 Year Bond	Septembre 2023	25.850.823	(51.811)
(272)	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	12.798.708	(14.097)
10	GBP	FTSE 100 Index	Septembre 2023	950.484	(12.296)
175	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	8.621.375	(207.200)
(76)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	Septembre 2023	23.661.080	(760.376)
(343)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	Septembre 2023	32.862.830	(508.442)
(41)	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	9.298.287	(240.721)
291	GBP	3 Month SONIA	Septembre 2023	87.527.461	(456.516)
19	KRW	Korean 10 Year Bond	Septembre 2023	1.575.200	(15.956)
327	KRW	Korean 3 Year Bond	Septembre 2023	25.620.669	(42.134)
213	USD	SGX FTSE China A50 Index	Septembre 2023	2.694.663	873
(56)	EUR	3 Month EURIBOR	Septembre 2023	14.610.523	(2.278)
(779)	EUR	EURO STOXX Banks Index	Septembre 2023	4.760.433	(346.521)
(1.726)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	209.816.875	(3.026.110)
(5.440)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	603.245.000	(5.518.497)
(7.208)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	836.015.375	(10.954.597)
(1.317)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	170.510.344	(2.503.618)
(280)	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	33.836.621	(278.198)
(2.215)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	451.133.201	(668.723)
1.206	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	128.806.453	102.194
1.164	USD	3 Month SOFR	Mars 2024	275.213.250	(1.053.271)
84	GBP	3 Month SONIA	Mars 2024	25.097.949	58.175
60	EUR	3 Month EURIBOR	Juin 2024	15.687.494	(66.168)
1.231	USD	3 Month SOFR	Juin 2024	291.639.287	(437.666)
1.090	USD	3 Month SOFR	Septembre 2024	259.052.125	(158.144)
23	GBP	3 Month SONIA	Septembre 2024	6.878.618	25.215
35	CAD	Banker's Acceptance	Septembre 2024	6.135.993	3.714
23	USD	3 Month SOFR	Décembre 2024	5.487.225	7.339
(1.151)	USD	3 Month SOFR	Mars 2025	275.606.950	1.869.945
Total				4.449.939.915	(23.308.624)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 3.044.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(41.587)	(21.385)
CDS	USD 3.045.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(41.600)	(21.392)
CDS	USD 3.040.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(41.532)	(21.357)
CDS	USD 3.044.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(41.205)	(21.385)
CDS	USD 4.260.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(57.665)	(29.928)
CDS	USD 1.844.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(24.962)	(12.955)
CDS	USD 11.294.412	Fund receives default protection on CVS Health; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(61.171)	(215.713)
CDS	EUR 4.450.000	Fund receives default protection on ENI; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(53.902)	(83.232)
CDS	EUR 1.558.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(21.457)	(21.013)
CDS	EUR 1.500.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(99.947)	(16.807)
CDS	USD 856.000	Fund receives default protection on Beazer Homes USA; and pays Fixed 5%	Barclays	20/6/2024	(20.814)	(29.992)
CDS	USD 215.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2024	(6.019)	5.576
CDS	USD 515.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2024	(13.649)	13.356
CDS	USD 250.000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Barclays	20/6/2024	(1.799)	10.023
CDS	USD 500.000	Fund receives default protection on THC; and pays Fixed 5%	Barclays	20/6/2024	(16.837)	(17.762)
CDS	USD (510.000)	Fund provides default protection on Sprint Communications; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2025	(56.463)	39.881
CDS	USD (725.000)	Fund provides default protection on Sprint Communications; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2025	(73.943)	56.693
CDS	USD (256.667)	Fund provides default protection on Sprint Communications; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2025	(26.972)	20.071
CDS	EUR (26.683)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2027	2.298	3.156
CDS	EUR (900.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2027	86.307	106.445
CDS	USD 346.223	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2027	(10.918)	(5.360)
CDS	EUR (159.806)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	(394)	(39.631)
CDS	EUR (100.709)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	(249)	(24.975)
CDS	EUR (283.073)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	(699)	(70.200)
CDS	USD 240.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2027	27.438	81.166
CDS	EUR (342.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	7.187	(13.823)
CDS	USD 13.188.750	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(640.771)	579.880
CDS	USD 1.409.599	Fund receives default protection on CVS Health; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(7.628)	(26.922)
CDS	USD 2.114.398	Fund receives default protection on CVS Health; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(11.528)	(40.383)
CDS	USD 1.409.599	Fund receives default protection on CVS Health; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(7.685)	(26.922)
CDS	USD 12.596.500	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(502.514)	338.439
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(28.948)	63.873
CDS	USD 2.366.784	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(40.671)	(15.581)
CDS	USD 1.881.511	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(25.125)	(12.387)
CDS	USD 12.259.512	Fund receives default protection on Mexican; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(222.099)	(5.590)
CDS	USD (525.000)	Fund provides default protection on Sprint Communications; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2025	(48.504)	41.054

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 500.000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2024	(7.065)	604
CDS	USD 1.250.000	Fund receives default protection on Boeing; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2024	(2.532)	(9.031)
CDS	USD (818.182)	Fund provides default protection on CCO; and receives Fixed 5%	BNP Paribas	20/12/2025	(85.669)	63.090
CDS	USD 750.000	Fund receives default protection on Borgwarner; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2027	(21.013)	(12.004)
CDS	EUR 247.191	Fund receives default protection on Ineos; and pays Fixed 5%	BNP Paribas	20/12/2027	(5.963)	(28.806)
CDS	EUR 1.310.000	Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2027	(38.785)	52.497
CDS	EUR (2.000.000)	Fund provides default protection on Intesa Sanpaolo; and receives Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	11.067	3.987
CDS	EUR 5.800.000	Fund receives default protection on HSBC; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(10.028)	(64.847)
CDS	EUR 450.000	Fund receives default protection on Picard; and pays Fixed 5%	BNP Paribas	20/6/2028	(11.295)	(2.734)
CDS	EUR 888.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(48.340)	(9.950)
CDS	EUR 2.000.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(13.733)	26.300
CDS	EUR 1.700.000	Fund receives default protection on Standard Chartered; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2028	(3.458)	(12.608)
CDS	EUR (720.000)	Fund provides default protection on Tkagr; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/12/2023	23.724	1.497
CDS	EUR (167.547)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	159	(41.550)
CDS	EUR (263.745)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	28.317	(12.037)
CDS	USD 32.345.960	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.39.V1; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/12/2027	(282.132)	(495.155)
CDS	USD 370.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/12/2027	40.011	125.131
CDS	USD 2.100.000	Fund receives default protection on Caterpillar; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(11.814)	(62.617)
CDS	USD 290.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	3.201	103.702
CDS	EUR (5.836.555)	Fund provides default protection on ITRAXX.XO.38.V1; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	116.290	311.420
CDS	USD 9.193.059	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.39.V1; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	(193.552)	(304.917)
CDS	EUR 26.382.000	Fund receives default protection on ITRAXX.FINSR.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(587.550)	(249.012)
CDS	EUR 11.356.603	Fund receives default protection on ITRAXX.FINSUB.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(509.717)	247.377
CDS	EUR 36.749.300	Fund receives default protection on ITRAXX.XO.39.V1; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	(513.360)	(1.646.761)
CDS	USD 1.567.604	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2028	(16.591)	(9.812)
CDS	USD (3.675.000)	Fund provides default protection on AT&T; and receives Fixed 1%	Citibank	20/12/2023	(2.364)	5.774
CDS	USD 215.000	Fund receives default protection on Ally Financial; and pays Fixed 5%	Citibank	20/6/2025	(3.228)	(11.541)
CDS	USD 325.000	Fund receives default protection on Ally Financial; and pays Fixed 5%	Citibank	20/6/2025	(4.882)	(17.446)
CDS	EUR 1.891.000	Fund receives default protection on Edf; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2025	(10.078)	(16.736)
CDS	USD 330.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2025	(16.373)	35.757
CDS	EUR (82.139)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Citibank	20/12/2027	390	(20.370)
CDS	EUR (84.622)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Citibank	20/12/2027	402	(20.986)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	15.416	50.729
CDS	USD 230.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	22.008	77.784
CDS	USD 250.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	4.619	84.548
CDS	USD 260.000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	(7.582)	18.551

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 10.130.000	Fund receives default protection on CVS Health; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2028	(45.857)	(193.474)
CDS	USD 2.350.000	Fund receives default protection on Southwest Airlines; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2028	(27.217)	(4.299)
CDS	USD (3.052.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.15.BBB-; and receives Fixed 3%	Citibank	15/11/2064	(153.188)	(744.128)
CDS	USD 750.000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Citibank	20/6/2024	28.120	30.068
CDS	USD 1.440.000	Fund receives default protection on CMBX.NA.9.BBB-; and pays Fixed 3%	Citibank	17/9/2058	260.288	305.697
CDS	EUR (110.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2026	5.384	11.175
CDS	EUR (244.777)	Fund provides default protection on Intrum Justitia; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(62.034)	(42.176)
CDS	EUR (155.223)	Fund provides default protection on Intrum Justitia; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(39.434)	(26.745)
CDS	EUR (2.200.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	157.219	260.200
CDS	EUR (147.145)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	12.391	17.403
CDS	EUR (425.714)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	67.615	50.350
CDS	EUR (638.572)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	100.864	75.526
CDS	USD (772.906)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	4.319	22.869
CDS	USD 3.310.811	Fund receives default protection on AT&T; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(39.973)	(3.868)
CDS	USD 4.138.513	Fund receives default protection on AT&T; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(39.685)	(4.835)
CDS	USD 2.350.676	Fund receives default protection on AT&T; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(12.877)	(2.746)
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(21.976)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(26.485)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(25.999)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(25.951)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(23.482)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(21.101)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(16.213)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(16.163)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(13.268)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(16.087)	63.873
CDS	USD 1.339.585	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(15.688)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(14.711)	63.873
CDS	USD 996.651	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(8.069)	47.521
CDS	USD 783.801	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(8.578)	(4.906)
CDS	USD 783.802	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(8.618)	(4.906)
CDS	EUR 335.000	Fund receives default protection on Verisure Midholding; and pays Fixed 5%	Deutsche Bank	20/6/2028	(236)	(39)
CDS	USD 2.009.377	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(20.321)	95.809
CDS	USD 250.000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2024	12	10.023
CDS	USD 165.000	Fund receives default protection on Macys; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(13.756)	721
CDS	USD 500.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(40.195)	54.177

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 250.000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(12.361)	(2.613)
CDS	USD 290.000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(11.627)	(3.031)
CDS	USD 665.000	Fund receives default protection on Southwest Airlines; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(13.393)	(5.571)
CDS	USD 665.000	Fund receives default protection on Southwest Airlines; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(12.850)	(5.571)
CDS	USD 1.040.000	Fund receives default protection on Southwest Airlines; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(31.089)	(8.712)
CDS	EUR (90.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2026	877	9.144
CDS	USD 3.525.000	Fund receives default protection on Caterpillar; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2026	(15.509)	(84.040)
CDS	EUR (425.714)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2027	65.959	50.350
CDS	EUR (748.195)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	71.913	(34.147)
CDS	EUR (375.000)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	32.548	(17.115)
CDS	USD 1.825.000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	(38.011)	(13.361)
CDS	EUR 1.310.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	(42.442)	47.604
CDS	EUR 1.372.000	Fund receives default protection on BNP Paribas; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(43.291)	8.863
CDS	USD 8.925.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(86.893)	392.413
CDS	USD 10.110.000	Fund receives default protection on Comcast; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(59.293)	(215.530)
CDS	EUR 1.891.000	Fund receives default protection on HSBC; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(8.655)	17.334
CDS	EUR 1.260.000	Fund receives default protection on HSBC; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(3.986)	11.550
CDS	EUR 129.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	298	27.595
CDS	USD 1.959.908	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(25.615)	(12.903)
CDS	USD 783.963	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(10.850)	(5.161)
CDS	EUR 331.500	Fund receives default protection on Novafives; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	1.484	12.558
CDS	USD 1.959.505	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(24.975)	(12.265)
CDS	EUR 2.100.000	Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2028	(8.185)	49.619
CDS	USD (1.003.333)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.A; and receives Fixed 2%	Goldman Sachs	17/9/2058	(70.076)	(89.171)
CDS	USD (948.150)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.A; and receives Fixed 2%	Goldman Sachs	17/9/2058	(66.182)	(84.267)
CDS	USD (1.003.333)	Fund provides default protection on CMBX.NA.A.9; and receives Fixed 2%	Goldman Sachs	17/9/2058	(72.190)	(89.171)
CDS	USD (900.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.BBB-14; and receives Fixed 3%	Goldman Sachs	16/12/2072	(68.442)	(220.542)
CDS	USD 825.000	Fund receives default protection on THC; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2024	(24.659)	(29.423)
CDS	USD 800.000	Fund receives default protection on THC; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2024	(23.912)	(28.532)
CDS	USD 875.000	Fund receives default protection on THC; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2024	(26.187)	(31.207)
CDS	USD 894.000	Fund receives default protection on THC; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2024	(29.748)	(31.758)
CDS	USD 250.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	28.550	84.548
CDS	EUR 4.525.000	Fund receives default protection on ING; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(53.987)	41.137
CDS	USD 2.679.168	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(56.581)	127.745
CDS	USD 783.963	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(10.781)	(5.161)
CDS	USD 783.963	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(10.781)	(5.161)
CDS	USD 1.567.604	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(18.438)	(9.812)
CDS	EUR 129.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	HSBC Bank	20/6/2028	(89)	27.595

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR 336.000	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	HSBC Bank	20/6/2028	1.551	499
CDS	EUR (227.000)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2024	(2.320)	(32.688)
CDS	EUR (1.110.000)	Fund provides default protection on Altice France; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2025	(990)	(86.893)
CDS	EUR (1.130.000)	Fund provides default protection on Virgin Media Finance; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2025	(105.291)	63.642
CDS	EUR (1.186.667)	Fund provides default protection on Altice France; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(103.841)	(133.623)
CDS	USD (850.000)	Fund provides default protection on CCO; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(91.487)	65.544
CDS	USD (490.909)	Fund provides default protection on CCO; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(52.304)	37.854
CDS	EUR (147.863)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2027	12.024	17.488
CDS	EUR (138.990)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2027	11.303	16.439
CDS	EUR (39.319)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2027	3.202	4.650
CDS	EUR (171.897)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	49	(42.629)
CDS	EUR (723.255)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	85.525	(33.009)
CDS	USD 390.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	13.613	131.895
CDS	USD 1.420.000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	(29.588)	(10.396)
CDS	EUR 1.129.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	(29.277)	41.027
CDS	USD 440.000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	(12.959)	31.395
CDS	EUR (6.100.000)	Fund provides default protection on Glencore International; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(2.088)	949.575
CDS	EUR (840.000)	Fund provides default protection on Loxam; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	85.963	(27.248)
CDS	EUR 2.000.000	Fund receives default protection on Aegon; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(4.062)	(21.923)
CDS	EUR 582.000	Fund receives default protection on Altice France; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	27.366	121.844
CDS	EUR 1.780.000	Fund receives default protection on Altice France; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	83.697	372.649
CDS	EUR 1.110.000	Fund receives default protection on Altice France; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(9.206)	232.382
CDS	EUR 1.600.000	Fund receives default protection on Barclays; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	1.246	53.208
CDS	EUR 975.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(87.758)	71.288
CDS	EUR 3.800.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(207.262)	97.567
CDS	EUR 2.227.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(58.328)	57.179
CDS	EUR 742.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(19.434)	19.051
CDS	EUR 831.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(24.596)	21.336
CDS	EUR 1.785.000	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(12.857)	2.649
CDS	EUR 419.500	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(1.313)	623
CDS	EUR 419.500	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(2.984)	623
CDS	EUR 298.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(4.132)	63.746
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(28.624)	63.873
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(28.670)	63.873

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 1.339.584	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(28.511)	63.873
CDS	USD 669.792	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(13.025)	31.936
CDS	USD 669.792	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(8.983)	31.936
CDS	USD 401.875	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(4.857)	19.162
CDS	EUR 2.400.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	5.120	50.286
CDS	USD 783.963	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(13.471)	(5.161)
CDS	EUR 571.000	Fund receives default protection on Novafives; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(5.508)	21.631
CDS	USD 1.230.000	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	4.820	57.291
CDS	USD 1.180.000	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	4.623	54.962
CDS	EUR 93.023	Fund receives default protection on Picard; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(93)	(565)
CDS	USD 1.959.505	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(28.968)	(12.265)
CDS	EUR 1.300.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(85.088)	(14.566)
CDS	EUR 750.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(48.634)	(8.404)
CDS	EUR 750.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(47.041)	(8.404)
CDS	EUR 779.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(53.582)	(8.729)
CDS	EUR 6.400.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(291.798)	(71.712)
CDS	EUR 2.250.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(114.087)	104.157
CDS	USD 820.000	Fund receives default protection on Donnelley & Sons; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2023	(9.403)	(6.834)
CDS	USD 1.644.000	Fund receives default protection on KB Home; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2023	(14.667)	(23.020)
CDS	USD 822.410	Fund receives default protection on Realty; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2023	(553)	(1.016)
CDS	USD 250.000	Fund receives default protection on THC; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2024	(8.372)	(8.916)
CDS	USD 1.110.000	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2024	(75.196)	(50.670)
CDS	USD 290.000	Fund receives default protection on Avis Budget; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2024	(20.258)	(13.849)
CDS	USD 1.380.000	Fund receives default protection on Avis Budget Car Rental; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2025	(143.166)	(81.005)
CDS	EUR (300.000)	Fund provides default protection on Virgin Media Finance; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(21.904)	17.469
CDS	EUR (1.070.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	108.823	(23.364)
CDS	EUR 2.325.000	Fund receives default protection on Commerzbank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(43.246)	143.372
CDS	USD 7.047.995	Fund receives default protection on CVS Health; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(44.140)	(134.610)
CDS	USD 3.523.997	Fund receives default protection on CVS Health; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(18.989)	(67.305)
CDS	USD 1.175.945	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(17.635)	(7.742)
CDS	EUR 7.525.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(80.755)	(101.491)
CDS	USD (35.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.10.BBB-; and receives Fixed 3%	JP Morgan	17/11/2059	(6.079)	(9.242)
CDS	USD 250.000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2023	1.318	2.401
CDS	USD 3.445.000	Fund receives default protection on Boeing; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/12/2024	(14.360)	(24.890)
CDS	USD (282.209)	Fund provides default protection on Mexican; and receives Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2026	5.677	3.790
CDS	USD 346.223	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(10.918)	(5.360)
CDS	USD 462.554	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(14.125)	(7.161)
CDS	EUR 680.851	Fund receives default protection on Naturgy Energy; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(11.568)	(12.530)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR 1.117.021	Fund receives default protection on Naturgy Energy; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(18.979)	(20.556)
CDS	EUR (124.635)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	(189)	(30.909)
CDS	EUR (232.425)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	(352)	(57.640)
CDS	USD 4.472.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(56.637)	196.624
CDS	EUR 221.000	Fund receives default protection on Novafives; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	5.192	8.372
CDS	EUR 2.250.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(17.928)	(30.346)
CDS	USD (2.006.667)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.A; and receives Fixed 2%	Morgan Stanley	17/9/2058	(144.825)	(178.343)
CDS	USD (1.000.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.BBB; and receives Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	(100.449)	(212.290)
CDS	USD (3.740.500)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.BBB; and receives Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	(375.959)	(794.070)
CDS	USD (598.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.BBB-; and receives Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	(124.284)	(126.949)
CDS	USD 811.501	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2025	(43.895)	(6.711)
CDS	USD 1.250.000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2025	(50.967)	(13.065)
CDS	USD 33.774	Fund receives default protection on CMBX.NA.9.AAA; and pays Fixed 0,5%	Morgan Stanley	17/9/2058	(293)	99
CDS	USD 3.605.883	Fund receives default protection on CMBX.NA.9.AAA; and pays Fixed 0,5%	Morgan Stanley	17/9/2058	(27.175)	10.624
CDS	USD 646.000	Fund receives default protection on CMBX.NA.9.BBB; and pays Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	103.751	137.139
CDS	USD 507.000	Fund receives default protection on CMBX.NA.9.BBB; and pays Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	81.428	107.631
CDS	USD 785.000	Fund receives default protection on Ford Motor; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	(34.519)	(71.640)
CDS	USD 750.000	Fund receives default protection on Beazer Homes USA; and pays Fixed 5%	BNP Paribas	20/6/2024	(19.185)	(26.278)
CDS	USD 500.000	Fund receives default protection on Beazer Homes USA; and pays Fixed 5%	BNP Paribas	20/6/2024	(12.414)	(17.519)
CDS	USD (490.909)	Fund provides default protection on CCO; and receives Fixed 5%	BNP Paribas	20/12/2025	(51.144)	37.854
CDS	USD 1.888.179	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(19.844)	(11.819)
CDS	USD 5.880.000	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.35; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/12/2025	(11.001)	(245.341)
CDS	USD 199.964.574	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.40; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(746.999)	(3.157.915)
CDS	EUR 16.150.000	Fund receives default protection on ITRAXX.EUR.39.V1; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(73.325)	(229.856)
IFS	EUR 7.045.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,56%	Bank of America	15/6/2028	6.488	6.488
IFS	EUR 4.665.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,46%	Bank of America	15/7/2028	19.947	19.947
IFS	EUR 5.835.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,555%	Bank of America	15/6/2033	(4.776)	(4.776)
IFS	EUR 5.895.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,505%	Bank of America	15/7/2033	(24.973)	(24.973)
IFS	EUR 1.694.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,5737%	Bank of America	15/5/2038	(8.294)	(8.294)
IFS	EUR 3.145.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,60125%	Bank of America	15/5/2043	(35.989)	(33.778)
IFS	GBP 2.000.000	Fund provides default protection UKRPI + 0bps; and receives Fixed 3,423%	Bank of America	15/3/2048	(367.504)	(367.504)
IFS	EUR 6.680.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,693%	Bank of America	15/8/2032	(152.787)	(152.787)
IFS	EUR 3.115.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,435%	Bank of America	15/5/2033	33.067	34.084

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IFS	GBP 3.395.000	Fund provides default protection UKRPI + 0bps; and receives Fixed 3,5325%	Morgan Stanley	15/11/2046	(543.602)	(543.602)
IRS	BRL 123.899.000	Fund receives Fixed 9,98%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2026	(62.334)	(62.334)
IRS	BRL 11.339.500	Fund receives Fixed 11,5625%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	60.578	60.578
IRS	BRL 13.156.807	Fund receives Fixed 11,82%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	87.639	87.639
IRS	BRL 115.197.000	Fund receives Fixed 10,3164%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	4/1/2027	54.805	54.805
IRS	BRL 13.277.676	Fund receives Fixed 11,27%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	2/1/2026	53.747	53.747
IRS	BRL 49.606.478	Fund receives Fixed 10,0325%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(88.296)	(88.296)
IRS	BRL 376.541	Fund receives Fixed 10,12%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(470)	(470)
IRS	BRL 67.465.547	Fund receives Fixed 10,1225%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(83.079)	(83.079)
IRS	BRL 1.570.000	Fund receives Fixed 9,94%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(3.332)	(3.332)
IRS	USD 854.267.523	Fund receives Fixed 4,4005%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	13/2/2024	(4.539.343)	(4.539.343)
IRS	USD 427.133.762	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,7505%	Bank of America	13/2/2024	3.480.066	3.480.066
IRS	MXN 279.585.258	Fund receives Fixed 4,68%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	27/2/2024	(547.537)	(547.537)
IRS	MXN 278.683.371	Fund receives Fixed 4,855%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	1/3/2024	(539.929)	(539.929)
IRS	USD 232.932.853	Fund receives Fixed 1,1285%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	7/3/2024	(5.173.827)	(5.173.827)
IRS	USD 349.576.239	Fund receives Fixed 1,12925%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	8/3/2024	(7.803.225)	(7.803.225)
IRS	USD 326.657.900	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,61%	Bank of America	8/3/2024	3.201.911	3.250.056
IRS	USD 469.854.799	Fund receives Fixed 1,079%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	18/3/2024	(11.152.238)	(11.152.238)
IRS	USD 94.081.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,61%	Bank of America	19/3/2024	979.654	986.546
IRS	GBP 458.228.116	Fund receives Fixed 3,22%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	3/4/2024	(8.330.928)	(8.330.928)
IRS	GBP 229.114.058	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 2,47%	Bank of America	3/4/2024	5.383.858	5.383.858
IRS	EUR 630.858.796	Fund receives Fixed 1,75%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	4/5/2024	(9.917.835)	(9.917.835)
IRS	EUR 315.429.398	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 1%	Bank of America	4/5/2024	6.639.695	6.639.695
IRS	USD 70.839.300	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	28/6/2024	1.071.907	1.082.379
IRS	KRW 33.396.220.000	Fund receives Fixed 3,865%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	3/7/2024	12.130	12.130
IRS	USD 410.521.000	Fund receives Fixed 4,4605%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	12/7/2024	(3.422.443)	(3.422.443)
IRS	USD 186.987.507	Fund receives Fixed 5,3715%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	12/7/2024	(143.222)	(143.222)
IRS	USD 186.987.506	Fund receives Fixed 5,3745%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	12/7/2024	(138.560)	(138.560)
IRS	USD 64.256.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,55%	Bank of America	13/7/2024	1.019.332	1.030.011
IRS	USD 94.577.700	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,57%	Bank of America	16/7/2024	1.503.620	1.502.373
IRS	USD 94.133.300	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	20/7/2024	1.520.458	1.525.430
IRS	USD 124.214.200	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	23/7/2024	2.009.727	2.015.758
IRS	USD 91.336.800	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	12/8/2024	1.555.063	1.546.793

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	USD 59.462.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	13/8/2024	1.015.251	1.009.261
IRS	USD 171.433.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,53%	Bank of America	27/8/2024	3.010.181	3.038.358
IRS	GBP 120.074.658	Fund receives Fixed 4,255%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	6/9/2024	(2.159.795)	(2.159.795)
IRS	COP 39.165.864.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 11,895%	Bank of America	19/10/2024	(29.586)	(29.586)
IRS	USD 388.107.062	Fund receives Fixed 4,592%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	14/12/2024	(1.865.318)	(1.865.652)
IRS	NZD 39.775.000	Fund receives Fixed 4,697%; and pays Floating NZD BBR 3 Month	Bank of America	20/12/2024	(197.463)	(197.463)
IRS	AUD 34.470.000	Fund receives Floating AUD BBSW 3 Month; and pays Fixed 4,0425%	Bank of America	20/12/2024	40.965	40.965
IRS	BRL 55.667.679	Fund receives Fixed 11,865%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	134.251	134.251
IRS	BRL 5.584.150	Fund receives Fixed 13,125%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	35.812	35.812
IRS	BRL 116.287.721	Fund receives Fixed 13,15%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	756.706	756.706
IRS	BRL 116.035.072	Fund receives Fixed 13,32%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	829.375	829.375
IRS	JPY 808.310.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,23%	Bank of America	11/1/2025	(13.255)	(13.255)
IRS	JPY 5.415.350.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,235%	Bank of America	19/1/2025	(91.647)	(91.647)
IRS	JPY 1.310.133.939	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,2%	Bank of America	3/2/2025	(17.856)	(17.856)
IRS	JPY 1.310.133.940	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,205%	Bank of America	3/2/2025	(18.497)	(18.497)
IRS	MXN 205.611.898	Fund receives Fixed 9,8%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	4/2/2025	(122.417)	(122.417)
IRS	MXN 772.497.615	Fund receives Fixed 9,9%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	5/2/2025	(397.209)	(397.209)
IRS	MXN 372.215.081	Fund receives Fixed 9,92%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	5/2/2025	(185.431)	(185.431)
IRS	MXN 869.313.000	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	7/2/2025	(409.515)	(409.515)
IRS	AUD 29.970.000	Fund receives Floating AUD BBSW 3 Month; and pays Fixed 3,8025%	Bank of America	9/2/2025	109.066	109.066
IRS	NZD 33.330.000	Fund receives Fixed 4,94%; and pays Floating NZD BBR 3 Month	Bank of America	10/2/2025	(168.721)	(168.721)
IRS	USD 233.257.979	Fund receives Fixed 2,601%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	17/2/2025	(8.235.320)	(8.235.320)
IRS	USD 233.257.979	Fund receives Fixed 2,701%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	17/2/2025	(7.910.463)	(7.910.463)
IRS	USD 434.496.685	Fund receives Fixed 4,031%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	10/3/2025	(6.755.639)	(6.755.639)
IRS	ZAR 457.077.000	Fund receives Fixed 7,2%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Bank of America	20/3/2025	(147.303)	(147.303)
IRS	CZK 973.667.000	Fund receives Floating CZK-PRIBOR-PRBO 3 Month; and pays Fixed 4,615%	Bank of America	19/6/2025	(168.836)	(168.836)
IRS	USD 49.554.240	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 4,7915%	Bank of America	4/8/2025	51.050	51.050
IRS	GBP 93.270.000	Fund receives Fixed 5,28523%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	7/8/2025	40.225	(6.501)
IRS	GBP 93.280.000	Fund receives Fixed 5,34%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	7/8/2025	49.167	51.866
IRS	EUR 208.790.000	Fund receives Floating EUR ESTR 1 Day; and pays Fixed 3,12083%	Bank of America	9/8/2025	(11.877)	(61.476)
IRS	USD 203.905.866	Fund receives Fixed 4,104%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	11/8/2025	(2.745.307)	(2.745.307)
IRS	USD 12.104.000	Fund receives Fixed 4,053%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	16/8/2025	(173.788)	(173.788)
IRS	GBP 9.960.000	Fund receives Fixed 5,795%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/8/2025	63.524	63.524

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	USD 5.819.000	Fund receives Fixed 4,1115%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	24/8/2025	(76.912)	(76.912)
IRS	USD 6.052.000	Fund receives Fixed 4,1527%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	24/8/2025	(75.329)	(75.329)
IRS	USD 5.819.000	Fund receives Fixed 4,1005%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	25/8/2025	(78.075)	(78.075)
IRS	USD 6.052.000	Fund receives Fixed 4,1327%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	25/8/2025	(77.557)	(77.557)
IRS	USD 11.639.000	Fund receives Fixed 4,181%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/8/2025	(138.279)	(138.279)
IRS	JPY 4.428.000.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,1045%	Bank of America	20/9/2025	25.105	25.105
IRS	USD 415.102.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,891%	Bank of America	5/12/2025	6.984.035	6.984.035
IRS	USD 54.507.000	Fund receives Fixed 3,8085%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	19/12/2025	(1.009.209)	(1.009.209)
IRS	GBP 8.890.000	Fund receives Fixed 3,6%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/3/2026	(117.373)	(117.837)
IRS	GBP 3.710.000	Fund receives Fixed 3,75343%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/3/2026	(51.668)	(42.850)
IRS	GBP 43.050.000	Fund receives Fixed 3,478%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	31/3/2026	(619.983)	(619.983)
IRS	GBP 4.440.000	Fund receives Fixed 3,7%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	31/3/2026	(53.007)	(53.007)
IRS	GBP 161.560.000	Fund receives Fixed 3,46%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	7/4/2026	(2.347.392)	(2.342.060)
IRS	USD 181.181.900	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,15%	Bank of America	26/5/2026	6.059.245	6.229.769
IRS	JPY 5.871.360.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,266%	Bank of America	7/7/2026	68.266	68.266
IRS	JPY 1.324.640.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,2925%	Bank of America	7/7/2026	13.015	13.015
IRS	JPY 1.324.450.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,3205%	Bank of America	7/7/2026	10.493	10.493
IRS	JPY 1.324.650.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,324%	Bank of America	7/7/2026	10.179	10.179
IRS	JPY 3.973.150.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,33%	Bank of America	7/7/2026	28.911	28.911
IRS	JPY 2.026.612.500	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,331%	Bank of America	7/7/2026	14.609	14.609
IRS	JPY 1.947.137.500	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,364%	Bank of America	7/7/2026	9.668	9.668
IRS	KRW 20.872.984.725	Fund receives Fixed 3,1875%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(206.410)	(206.410)
IRS	KRW 15.427.858.275	Fund receives Fixed 3,19%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(151.740)	(151.740)
IRS	KRW 8.277.065.211	Fund receives Fixed 3,33%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(56.633)	(56.633)
IRS	KRW 11.569.578.649	Fund receives Fixed 3,376%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(67.783)	(67.783)
IRS	KRW 8.278.306.895	Fund receives Fixed 3,38%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(47.792)	(47.792)
IRS	KRW 8.278.306.894	Fund receives Fixed 3,3825%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(47.350)	(47.350)
IRS	KRW 11.569.578.650	Fund receives Fixed 3,384%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(65.804)	(65.804)
IRS	KRW 11.567.843.300	Fund receives Fixed 3,389%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(64.557)	(64.557)
IRS	BRL 27.019.000	Fund receives Fixed 10,04%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(51.925)	(51.925)
IRS	BRL 3.150.000	Fund receives Fixed 10,11%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(3.717)	(3.717)
IRS	BRL 70.316.840	Fund receives Fixed 10,12%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(87.716)	(87.716)
IRS	BRL 57.809.236	Fund receives Fixed 9,965%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(105.308)	(105.308)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	BRL 12.186.000	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 10,1%	Bank of America	4/1/2027	8.939	8.939
IRS	USD 116.466.427	Fund receives Fixed 1,549%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	7/3/2027	(10.287.733)	(10.287.733)
IRS	USD 41.805.000	Fund receives Fixed 3,468%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	10/3/2027	(123.312)	(123.312)
IRS	GBP 20.240.000	Fund receives Fixed 3,44723%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	16/3/2027	(231.250)	(202.634)
IRS	USD 116.003.796	Fund receives Fixed 2,9095%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	6/10/2027	(5.467.517)	(5.467.517)
IRS	MXN 190.277.000	Fund receives Fixed 8,42%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	20/1/2028	(249.101)	(249.101)
IRS	GBP 20.860.000	Fund receives Fixed 3,2%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/1/2028	(201.784)	(195.443)
IRS	GBP 143.664.300	Fund receives Fixed 3,18%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	10/2/2028	(1.357.870)	(1.357.870)
IRS	MXN 101.706.000	Fund receives Fixed 8,35%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	28/4/2028	(143.896)	(143.896)
IRS	GBP 10.210.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 4,638%	Bank of America	26/5/2028	108.255	108.255
IRS	EUR 9.711.000	Fund receives Fixed 3,1518%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	21/7/2028	(3.458)	(3.458)
IRS	GBP 2.150.000	Fund receives Fixed 4,86823%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	4/8/2028	5.079	7.105
IRS	GBP 2.160.000	Fund receives Fixed 4,8733%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	4/8/2028	7.731	7.731
IRS	GBP 2.100.000	Fund receives Fixed 4,77918%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	11/8/2028	7.487	(2.796)
IRS	GBP 2.120.000	Fund receives Fixed 4,9008%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	11/8/2028	11.168	11.168
IRS	MXN 414.714.000	Fund receives Fixed 9,1343%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	15/8/2028	209.025	209.025
IRS	CZK 227.669.000	Fund receives Fixed 4,321%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	40.770	40.770
IRS	PLN 32.083.000	Fund receives Floating PLN WIBOR 6 Month; and pays Fixed 5,7005%	Bank of America	20/9/2028	(407.088)	(407.087)
IRS	USD 64.027.800	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,92%	Bank of America	16/2/2029	3.228.652	3.391.285
IRS	USD 126.206.600	Fund receives Fixed 2,85%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	14/10/2031	(7.928.148)	(8.845.040)
IRS	USD 67.115.000	Fund receives Fixed 2,86%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	19/11/2031	(4.263.776)	(4.696.034)
IRS	USD 142.421.500	Fund receives Fixed 2,85%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/1/2032	(9.187.335)	(10.221.088)
IRS	USD 10.222.322	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,3525%	Bank of America	8/4/2032	1.111.675	1.111.675
IRS	USD 63.216.532	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,58%	Bank of America	24/5/2032	5.879.344	5.891.838
IRS	EUR 8.974.000	Fund receives Fixed 2,4425%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	14/7/2032	(170.931)	(170.931)
IRS	USD 53.540.807	Fund receives Fixed 3,04%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/10/2032	(3.279.642)	(3.279.642)
IRS	USD 54.305.155	Fund receives Fixed 2,868%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	2/11/2032	(4.042.329)	(4.042.329)
IRS	USD 54.182.125	Fund receives Fixed 2,908%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	4/11/2032	(3.869.785)	(3.869.785)
IRS	USD 87.128.964	Fund receives Fixed 2,8905%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	15/11/2032	(6.353.855)	(6.353.855)
IRS	USD 53.201.779	Fund receives Fixed 3,191%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/11/2032	(2.663.401)	(2.663.401)
IRS	AUD 6.960.000	Fund receives Fixed 4,15%; and pays Floating AUD BBSW 6 Month	Bank of America	9/2/2033	(78.067)	(78.067)
IRS	NZD 7.710.000	Fund receives Floating NZD BBR 3 Month; and pays Fixed 4,2525%	Bank of America	10/2/2033	159.192	159.192
IRS	CAD 607.150	Fund receives Fixed 3,3%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	27/3/2033	(31.620)	(31.576)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	CAD 617.168	Fund receives Fixed 3,35%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	30/3/2033	(28.866)	(30.155)
IRS	EUR 8.090.000	Fund receives Fixed 2,962%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	31/3/2033	(64.138)	(63.077)
IRS	CHF 5.050.000	Fund receives Floating CHF SARON 1 Day; and pays Fixed 1,912%	Bank of America	31/3/2033	(101.807)	(96.790)
IRS	CAD 1.825.430	Fund receives Fixed 3,28%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	25/4/2033	(89.622)	(95.711)
IRS	CAD 618.755	Fund receives Fixed 3,442%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	9/5/2033	(25.936)	(25.936)
IRS	CAD 628.587	Fund receives Fixed 3,3625%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	12/5/2033	(29.294)	(29.331)
IRS	CAD 1.883.532	Fund receives Fixed 3,43%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	15/5/2033	(70.711)	(79.937)
IRS	CAD 641.426	Fund receives Fixed 3,77%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	30/5/2033	(13.292)	(13.595)
IRS	CAD 648.653	Fund receives Fixed 3,6829%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	31/5/2033	(17.188)	(17.188)
IRS	CAD 599.152	Fund receives Fixed 3,677%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	1/6/2033	(16.069)	(16.069)
IRS	CAD 119.537	Fund receives Fixed 3,921%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	13/6/2033	(1.416)	(1.416)
IRS	GBP 1.610.000	Fund receives Fixed 3,4329%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/6/2033	(23.899)	(23.899)
IRS	GBP 2.120.000	Fund receives Fixed 3,6589%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/6/2033	(9.716)	(9.716)
IRS	MXN 38.177.000	Fund receives Fixed 8,5%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	28/7/2033	(40.544)	(40.544)
IRS	USD 51.841.870	Fund receives Fixed 3,7565%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	9/8/2033	(309.060)	(309.060)
IRS	USD 25.362.638	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,23%	Bank of America	9/8/2033	1.241.366	1.241.366
IRS	EUR 4.140.000	Fund receives Fixed 2,85708%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	28/8/2033	11.521	10.606
IRS	USD 8.083.900	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,93%	Bank of America	26/11/2041	905.172	889.716
IRS	EUR 560.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,668%	Bank of America	4/2/2048	19.569	19.569
IRS	EUR 3.220.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,8133%	Bank of America	15/8/2048	16.453	16.453
IRS	USD 18.194.800	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,81%	Bank of America	25/1/2051	2.696.963	2.421.522
IRS	USD 33.463.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,81%	Bank of America	28/1/2051	4.962.153	4.453.452
IRS	USD 18.855.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	1/2/2051	2.791.919	2.541.496
IRS	USD 10.566.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	4/2/2051	1.565.186	1.424.192
IRS	USD 10.880.700	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	5/2/2051	1.611.717	1.466.536
IRS	USD 4.450.600	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	22/2/2051	839.017	599.750
IRS	USD 16.715.200	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	27/5/2051	3.167.330	2.248.716
IRS	USD 2.732.300	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	28/5/2051	517.738	367.582
IRS	USD 36.909.800	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,79%	Bank of America	21/1/2052	7.084.248	5.014.935
IRS	JPY 19.611.570	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,88%	Bank of America	23/5/2052	17.173	17.173
IRS	JPY 16.172.460	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,85%	Bank of America	26/5/2052	14.971	14.971
IRS	JPY 16.172.460	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,7915%	Bank of America	27/5/2052	16.537	16.537
IRS	JPY 49.810.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,99%	Bank of America	26/7/2052	34.780	34.780
IRS	JPY 37.745.000	Fund receives Fixed 1,10625%; and pays Floating JPY TONAR 1 Day	Bank of America	12/9/2052	(19.163)	(19.163)
IRS	JPY 37.745.000	Fund receives Fixed 1,13%; and pays Floating JPY TONAR 1 Day	Bank of America	12/9/2052	(17.667)	(17.667)
IRS	EUR 240.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,761%	Bank of America	4/10/2052	(1.045)	(1.045)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	EUR 990.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,2705%	Bank of America	4/3/2053	97.818	97.818
IRS	CAD 263.099	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,37%	Bank of America	27/3/2053	18.187	18.141
IRS	CAD 267.440	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,4%	Bank of America	30/3/2053	16.640	17.325
IRS	CHF 2.060.000	Fund receives Fixed 1,8565%; and pays Floating CHF SARON 1 Day	Bank of America	31/3/2053	77.987	72.571
IRS	EUR 2.300.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,508%	Bank of America	31/3/2053	108.573	107.791
IRS	CAD 791.019	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,32%	Bank of America	25/4/2053	54.150	58.986
IRS	CAD 268.127	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,4841%	Bank of America	9/5/2053	13.851	13.851
IRS	CAD 272.388	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,375%	Bank of America	12/5/2053	18.266	18.039
IRS	CAD 816.197	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,44%	Bank of America	15/5/2053	43.170	46.785
IRS	CAD 277.951	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,66%	Bank of America	30/5/2053	6.700	7.520
IRS	CAD 281.083	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,5816%	Bank of America	31/5/2053	10.566	10.566
IRS	CAD 260.501	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,5595%	Bank of America	1/6/2053	10.553	10.553
IRS	CAD 51.800	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,7685%	Bank of America	13/6/2053	631	631
IRS	USD 880.417	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8417%	Bank of America	25/8/2053	(1.690)	(1.690)
IRS	USD 65.616.484	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2%	BNP Paribas	17/2/2025	2.865.847	2.865.847
IRS	GBP 630.000	Fund receives Fixed 5,628%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	19/8/2025	2.469	2.581
IRS	GBP 20.560.000	Fund receives Fixed 5,65%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	22/8/2025	90.666	90.666
IRS	GBP 30.480.000	Fund receives Fixed 5,4%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	23/8/2025	50.036	48.822
IRS	USD 51.465.000	Fund receives Fixed 3,75736%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	15/12/2025	(1.010.079)	(1.010.079)
IRS	GBP 32.400.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 4,75%	Bank of America	26/8/2026	(56.498)	(52.717)
IRS	ZAR 222.097.804	Fund receives Floating ZAR JIBAR 3 Month; and pays Fixed 8,22%	Bank of America	20/9/2026	(99.494)	(99.494)
IRS	GBP 25.665.000	Fund receives Fixed 4,86%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	20/6/2028	41.963	41.963
IRS	EUR 41.523.251	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 0,02%	Goldman Sachs	26/8/2031	9.584.771	9.584.771
IRS	USD 11.858.932	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,585%	Goldman Sachs	26/5/2032	1.101.552	1.101.552
IRS	USD 50.468.327	Fund receives Fixed 3,4665%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	4/10/2032	(1.444.793)	(1.444.793)
IRS	USD 23.973.778	Fund receives Fixed 3,415%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	5/10/2032	(779.973)	(779.973)
IRS	EUR 31.939.000	Fund receives Fixed 2,34%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	19/1/2033	(567.354)	(567.354)
IRS	USD 56.994.117	Fund receives Fixed 3,136%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	12/5/2033	(884.612)	(884.612)
IRS	EUR 6.920.000	Fund receives Fixed 2,78%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	1/8/2033	(6.636)	(3.402)
IRS	MXN 18.885.000	Fund receives Fixed 8,58%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	1/8/2033	(14.080)	(14.080)
IRS	EUR 3.580.000	Fund receives Fixed 3%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	17/8/2033	34.578	32.149
IRS	EUR 16.640.000	Fund receives Fixed 3,0313%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	23/8/2033	171.025	171.025
IRS	USD 19.440.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,8642%	Bank of America	23/8/2033	(223.238)	(223.238)
IRS	EUR 11.130.000	Fund receives Fixed 2,87515%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	25/8/2033	39.082	37.805

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	USD 13.020.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,71334%	Bank of America	25/8/2033	(85.853)	(75.872)
IRS	ZAR 113.535.584	Fund receives Fixed 9,895%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Bank of America	20/9/2033	232.552	232.552
IRS	ZAR 56.767.792	Fund receives Fixed 9,896%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Bank of America	20/9/2033	116.475	116.475
IRS	ZAR 56.767.792	Fund receives Fixed 9,9175%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Bank of America	20/9/2033	120.760	120.760
IRS	USD 4.780.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,828%	Bank of America	26/8/2035	(95.447)	(94.562)
IRS	BRL 258.795.934	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(8.803)	(8.803)
IRS	BRL 283.000.557	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(9.627)	(9.627)
IRS	COP 75.525.656.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 12,37%	Citibank	18/4/2024	14.552	14.552
IRS	BRL 31.919.188	Fund receives Fixed 13,22%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2025	216.120	216.120
IRS	BRL 54.321.000	Fund receives Fixed 11,745%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	339.253	339.253
IRS	BRL 4.732.026	Fund receives Fixed 11,76%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	29.990	29.990
IRS	BRL 60.073.885	Fund receives Fixed 11,8%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	393.682	393.682
IRS	BRL 52.770.635	Fund receives Fixed 10,1%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(72.583)	(72.583)
IRS	BRL 56.273.050	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(107.763)	(107.763)
IRS	MXN 274.683.000	Fund receives Fixed 6,02%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Citibank	24/3/2026	(1.370.714)	(1.370.714)
IRS	COP 23.767.988.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 10,2%	Goldman Sachs	28/2/2025	2.092	2.092
IRS	BRL 128.965.000	Fund receives Fixed 10,1075%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	2/1/2026	1.025	1.025
IRS	BRL 81.608.634	Fund receives Fixed 10,005%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(168.517)	(168.517)
IRS	BRL 140.975.999	Fund receives Fixed 10,05%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(235.186)	(235.186)
IRS	BRL 5.601.000	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 10,105%	Goldman Sachs	4/1/2027	4.436	4.436
IRS	MXN 414.800.000	Fund receives Fixed 7,481%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Goldman Sachs	14/4/2027	(1.329.459)	(1.329.459)
IRS	BRL 60.676.416	Fund receives Fixed 13,18%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2025	401.666	401.666
IRS	BRL 4.940.556	Fund receives Fixed 11,775%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2026	31.711	31.711
IRS	BRL 56.143.465	Fund receives Fixed 10,025%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	(81.293)	(81.293)
IRS	BRL 3.140.000	Fund receives Fixed 10,425%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	15	15
IRS	USD 432.055.000	Fund receives Fixed 4,505%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	9/3/2024	(2.406.810)	(2.406.810)
IRS	BRL 232.775.572	Fund receives Fixed 12,7825%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2025	1.196.044	1.196.044
IRS	BRL 8.688.363	Fund receives Fixed 11,83%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2026	58.343	58.343
IRS	BRL 56.203.890	Fund receives Fixed 9,99%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	4/1/2027	(93.636)	(93.636)
IRS	MXN 279.950.277	Fund receives Floating MXN MXIBTIIE 1 Month; and pays Fixed 7,71%	BNP Paribas	19/11/2026	773.885	773.886
IRS	MXN 144.525.723	Fund receives Floating MXN MXIBTIIE 1 Month; and pays Fixed 7,64%	UBS	18/11/2026	416.261	416.261
TRS	USD (5.757)	Fund receives USD SOFR 1 Day - 100bps; and pays Western Alliance + 0bps	Citibank	6/9/2023	13.817	(289.865)
TRS	USD 2.517	Fund receives S5INDU Performance Shell + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 38bps	Citibank	20/9/2023	64.988	64.988

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
TRS	USD 7.877.609	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	(60.754)	(68.854)
TRS	USD 10.364.590	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	121.098	96.947
TRS	USD 94.891	Fund receives JPM EMBIG DIV CORE + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 75bps	JP Morgan	20/9/2023	(487.423)	(487.423)
TRS	USD 26.764.109	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	JP Morgan	20/9/2023	313.331	250.341
TRS	USD 12.462.500	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	(16.813)	(28.917)
TRS	USD 20.975.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	245.068	196.192
TRS	USD 5.000.000	Fund receives USD SOFR 1 Day + 0bps; and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	7.673	18.984
TRS	USD 34.999.049	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	BNP Paribas	20/9/2023	431.220	345.798
TRS	USD 16.433.000	Fund receives USD SOFR 1 Day + 0bps; and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps	BNP Paribas	20/9/2023	(155.323)	(117.031)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 13.880.828.434)					(65.928.357)	(67.771.680)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
10.485.000	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 145	1/9/2023	(3.036)	88.121
580.000	Put	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1,017	12/9/2023	(24.449)	-
8.357.856	Put	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7,1	22/9/2023	(75.443)	1.876
5.888.000	Put	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 4,65	27/9/2023	(14.426)	1.412
5.338.000	Put	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,4	6/10/2023	3.300	112.237
8.288.400	Call	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7,35	16/10/2023	(8.039)	9.367
4.972.965	Call	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0,67	9/11/2023	(6.721)	8.629
10.690.000	Put	OTC USD/INR	Bank of America	USD 82,6	15/11/2023	(9.705)	7.399
8.550.000	Put	OTC USD/INR	Bank of America	USD 82,6	15/11/2023	(11.182)	5.918
4.870.000	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 150	1/5/2024	8.942	37.285
12.514.591	Call	OTC USD/NOK	Barclays	USD 10,7	22/9/2023	73.310	134.131
7.350.000	Put	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7,1	28/9/2023	(57.198)	3.366
5.844.000	Put	OTC USD/MXN	Barclays	USD 17,2	6/10/2023	75.418	160.875
5.316.000	Put	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,08	16/10/2023	5.694	40.203
5.670.000	Call	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,125	20/12/2023	(30.043)	25.800
656.000	Put	OTC USD/JPY	Citibank	USD 125	7/9/2023	(104.304)	-
1.670.000	Put	OTC USD/CNH	Citibank	USD 7,1	25/9/2023	(16.449)	2.589
736.000	Put	OTC CNH/USD	Citibank	USD 7,22	26/1/2024	34.149	124.677
5.298.000	Call	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,105	11/9/2023	(52.673)	2.112
13.271.590	Put	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 4,8	19/9/2023	(62.363)	28.773
29.140.000	Call	OTC USD/HKD	Goldman Sachs	USD 7,81	8/11/2023	25.818	69.674
670.000	Put	OTC PLN/EUR	HSBC Bank	EUR 4,66	1/11/2023	74.106	159.104
45.710.000	Call	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7,82	10/11/2023	12.163	65.873
545.000	Put	OTC EUR/USD	HSBC Bank	EUR 1,05	16/11/2023	(237)	72.024
201.961.668	Call	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 8,5	21/8/2024	(241.706)	55.784
71.964.757	Put	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,099	25/9/2023	538.245	1.143.276
25.007.076	Call	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0,7	2/10/2023	(14.733)	1.040
8.260.000	Call	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,133	12/10/2023	(59.018)	2.937
19.630.000	Put	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6,9	18/10/2023	(91.174)	891
12.546.157	Call	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 143	31/10/2023	146.473	280.968
16.589.487	Put	OTC USD/CAD	JP Morgan	USD 1,3	8/11/2023	(23.044)	9.471
62.527.455	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16,6	12/9/2023	(188.887)	134.380

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values)	Valeur de marché
						non réalisées USD	
1.170.000	Put	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1,06	27/9/2023	95.277	248.510
1.424.000	Put	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1,06	20/10/2023	246.427	483.470
40.131.800	Call	OTC USD/HKD	Morgan Stanley	USD 7,81	13/11/2023	19.083	93.166
4.171.530	Put	OTC USD/NOK	UBS	USD 9,8	22/9/2023	(24.976)	345
604	Put	EURO STOXX 50 Index	Bank of America	EUR 4.000	20/10/2023	(9.762)	13.516
1.187	Put	EURO STOXX 50 Index	Bank of America	EUR 4.100	20/10/2023	(13.891)	39.934
2.277.000	Call	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 239,439	10/11/2023	19.828	168.151
912	Put	EURO STOXX 50 Index	BNP Paribas	EUR 4.125	17/11/2023	14.366	36.518
755	Call	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.100	15/9/2023	(68.379)	100
509.721.096	Put	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,07	27/9/2023	(890.121)	1.891
3.055	Put	NXP Semiconductors	Goldman Sachs	EUR 715	20/10/2023	(21.058)	-
3.793.482	Call	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 239,3	10/11/2023	27.034	281.894
1.519.518	Call	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 239,43	10/11/2023	25.774	112.259
2.043	Call	NASDAQ 100 Index	UBS	USD 15.700	15/9/2023	(92.111)	282.780
58	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 500	1/9/2023	(26.485)	26.245
116	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 449	1/9/2023	16.779	46.806
116	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 449	1/9/2023	(16.946)	6.438
108	Put	Spirax-Sarco Engineering	Exchange Traded	USD 4.400	1/9/2023	(429.372)	4.050
200	Put	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 15	15/9/2023	(5.447)	2.500
156	Put	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 12,5	15/9/2023	(8.886)	3.120
200	Put	Ally Financial	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(7.546)	2.500
874	Put	Ally Financial	Exchange Traded	USD 20	15/9/2023	(153.289)	2.622
623	Call	Barclays	Exchange Traded	GBP 1,6	15/9/2023	(26.560)	1.974
625	Call	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(83.581)	1.563
27	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	150.017	189.810
41	Call	First Solar	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(32.864)	3.095
827	Call	Ford Motor	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(42.344)	827
248	Call	General Motors	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(37.806)	620
246	Call	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 60	15/9/2023	(62.364)	3.321
103	Call	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 62,5	15/9/2023	(26.061)	670
575	Call	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(102.194)	2.587
95	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 360	15/9/2023	(98.628)	2.422
103	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 355	15/9/2023	(120.585)	4.171
102	Put	NVIDIA	Exchange Traded	USD 375	15/9/2023	(48.703)	1.377
400	Put	PG&E	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(4.692)	1.600
450	Put	PG&E	Exchange Traded	USD 14	15/9/2023	(5.789)	1.125
75	Put	RingCentral	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(2.323)	750
135	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 5	15/9/2023	1.198	3.982
124	Put	Seagate Technology	Exchange Traded	USD 57,5	15/9/2023	(5.324)	372
81	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	15/9/2023	(11.298)	365
682	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	(475.425)	29.667
500	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(3.865)	3.750
200	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 17	15/9/2023	(3.546)	1.500
357	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(70.946)	9.103
149	Call	UniCredit	Exchange Traded	EUR 23	15/9/2023	(31.991)	28.492
77	Call	United Rentals	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	16.610	186.725
186	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(53.332)	5.673
70	Put	Viasat	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(4.286)	1.225
33	Put	Viasat	Exchange Traded	USD 22,5	15/9/2023	(692)	330
103	Call	Vinci	Exchange Traded	EUR 110	15/9/2023	(22.798)	894
200	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 25	20/9/2023	(10.946)	2.700
816	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 445	22/9/2023	(37.316)	224.808
45	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 108,5	22/9/2023	(10.968)	4.570
31	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 461	29/9/2023	(16.913)	6.913
481	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 94,875	13/10/2023	284.569	393.819
721	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95	13/10/2023	601.640	802.112
1.202	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,625	13/10/2023	1.905.505	3.170.275
1.232	Call	Alibaba	Exchange Traded	USD 110	20/10/2023	(226.355)	117.656
132	Put	Ally Financial	Exchange Traded	USD 23	20/10/2023	(3.367)	3.630

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
143	Call	Apple	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	111.136	166.595
71	Call	Apple	Exchange Traded	USD 185	20/10/2023	35.621	56.977
100	Call	Equitrans Midstream	Exchange Traded	USD 12	20/10/2023	(3.623)	500
286	Call	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(32.669)	8.723
408	Call	Micron Technology	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	94.748	169.320
520	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 435	20/10/2023	(209.041)	160.940
816	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 463	20/10/2023	32.702	308.040
200	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	20/10/2023	(3.046)	3.000
204	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/11/2023	5.364	87.210
15	Call	Broadcom	Exchange Traded	USD 900	17/11/2023	34.274	95.550
1.225	Call	Kenvue	Exchange Traded	USD 25	17/11/2023	(24.172)	70.437
77	Call	Lennar	Exchange Traded	USD 135	17/11/2023	(38.399)	11.357
194	Call	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 140	17/11/2023	7.010	95.545
308	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 94	15/12/2023	(15.094)	8.662
400	Put	Ford Motor	Exchange Traded	USD 10	15/12/2023	508	7.400
150	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 14	15/12/2023	(2.135)	2.250
124	Put	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 500	15/12/2023	(18.084)	22.198
124	Put	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 600	15/12/2023	(30.753)	117.044
350	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 6	19/1/2024	12.172	19.600
200	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 7	19/1/2024	2.854	7.500
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 696.914.194)						(165.863)	11.280.328

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(10.485.000)	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 145	1/9/2023	(46.663)	(88.121)
(10.029.427)	Put	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6,95	22/9/2023	29.140	(16)
(5.338.000)	Call	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,7	6/10/2023	40.939	(14.624)
(5.338.000)	Put	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,2	6/10/2023	6.633	(26.373)
(10.104.000)	Put	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7,27	6/10/2023	4.953	(69.230)
(4.171.530)	Put	OTC USD/NOK	Barclays	USD 9,8	22/9/2023	44.249	(345)
(7.350.000)	Call	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7,25	28/9/2023	(24.131)	(48.239)
(7.350.000)	Put	OTC USD/CNH	Barclays	USD 6,95	28/9/2023	16.178	(65)
(4.382.000)	Call	OTC USD/MXN	Barclays	USD 18,3	6/10/2023	28.237	(2.437)
(5.844.000)	Put	OTC USD/MXN	Barclays	USD 16,7	6/10/2023	(20.664)	(47.839)
(5.316.000)	Call	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,115	16/10/2023	12.237	(10.557)
(7.946.000)	Call	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,12	11/9/2023	37.237	(154)
(46.570.000)	Put	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,06	27/9/2023	57.278	(56.302)
(3.317.897)	Call	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 5,05	19/9/2023	25.850	(13.430)
(24.884.231)	Put	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 4,68	19/9/2023	47.507	(6.641)
(45.710.000)	Call	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7,85	10/11/2023	3.915	(7.513)
(4.965.466)	Call	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146,5	11/9/2023	7.559	(22.145)
(4.965.466)	Put	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146,5	11/9/2023	(10.355)	(40.058)
(71.964.757)	Put	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,079	25/9/2023	(121.218)	(354.654)
(19.630.000)	Put	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6,775	18/10/2023	36.372	(42)
(20.954.425)	Call	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146,5	31/10/2023	(108.036)	(206.627)
(4.145.897)	Call	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 143	31/10/2023	(29.248)	(92.846)
(5.670.000)	Call	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,125	20/12/2023	68.315	(25.800)
(62.527.455)	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16,2	12/9/2023	87.438	(2.602)
(20.342.900)	Call	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,11	20/10/2023	14.404	(41.299)
(12.514.591)	Call	OTC USD/NOK	UBS	USD 10,7	22/9/2023	(57.542)	(134.131)
(2.277.000)	Call	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 262,243	10/11/2023	18.745	(52.176)
(509.721.096)	Call	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,57	27/9/2023	261.811	-
(509.721.096)	Call	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,68	27/9/2023	383.504	(126.217)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(3.793.482)	Call	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 262,09	10/11/2023	31.143	(87.680)
(1.519.518)	Call	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 262,232	10/11/2023	(4)	(34.838)
(117)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.300	1/9/2023	195.493	(1.755)
(625)	Call	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	20.482	(625)
(41)	Put	First Solar	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	(20.182)	(33.005)
(827)	Put	Ford Motor	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(54.358)	(73.190)
(248)	Put	General Motors	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	(20.921)	(42.408)
(246)	Put	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	15.165	(2.583)
(103)	Put	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	1.236	(10.352)
(575)	Put	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 41	15/9/2023	17.406	(8.913)
(154)	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 380	15/9/2023	74.269	(847)
(95)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 320	15/9/2023	27.365	(20.710)
(682)	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	194.846	(8.525)
(357)	Put	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 42,5	15/9/2023	38.295	(4.820)
(149)	Put	UniCredit	Exchange Traded	EUR 20	15/9/2023	29.865	(3.193)
(103)	Put	Vinci	Exchange Traded	EUR 100	15/9/2023	9.075	(4.582)
(200)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 40	20/9/2023	3.354	(800)
(313)	Put	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 106,5	22/9/2023	119.335	(119.820)
(481)	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 95,125	13/10/2023	(463.987)	(679.412)
(721)	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,25	13/10/2023	(869.908)	(1.234.712)
(1.202)	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,375	13/10/2023	(1.617.895)	(2.426.537)
(1.232)	Call	Alibaba	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	58.852	(24.640)
(214)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	31.378	(9.309)
(286)	Put	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 40	20/10/2023	(826)	(14.729)
(408)	Put	Micron Technology	Exchange Traded	USD 52,5	20/10/2023	27.908	(8.364)
(43)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.250	20/10/2023	47.291	(76.110)
(65)	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 109	27/10/2023	38.493	(32.500)
(204)	Put	Amazon.com	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	13.950	(30.498)
(15)	Put	Broadcom	Exchange Traded	USD 760	17/11/2023	17.742	(13.950)
(1.225)	Put	Kenvue	Exchange Traded	USD 20	17/11/2023	5.840	(21.438)
(77)	Put	Lennar	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(13.789)	(34.265)
(194)	Put	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(5.909)	(25.317)
(408)	Put	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 105,5	24/11/2023	83.807	(194.437)
(161)	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/12/2023	(277.075)	(668.633)
(248)	Put	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 550	15/12/2023	52.842	(97.537)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 611.200.649)						(1.374.778)	(7.541.517)

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD 201.353.051	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 8/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 8/9/2024	Morgan Stanley	6/9/2023	(1.479.752)	315.140
USD 102.651.282	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,65% Fixed semi-annually from 14/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/9/2024	Citibank	12/9/2023	(671.945)	14.792
USD 30.539.807	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 15/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/9/2024	Citibank	13/9/2023	(234.276)	3.323
USD 5.000.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(11.285)	8.440
USD 5.000.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	BNP Paribas	20/9/2023	(15.660)	4.040
USD 5.000.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(24.206)	3.045

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD 5.000.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Barclays	20/9/2023	(14.453)	5.697
EUR 115.560.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.EUR.39.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 1% Fixed	Morgan Stanley	20/9/2023	(134.580)	77.654
USD 30.467.706	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,81% Fixed semi-annually from 25/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 25/9/2024	Morgan Stanley	21/9/2023	(568.798)	35
USD 13.001.291	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,8% Fixed semi-annually from 26/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/9/2024	Morgan Stanley	22/9/2023	(322.406)	19
USD 58.253.923	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,75% Fixed annually from 23/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 23/10/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	(245.022)	10.324
USD 50.109.750	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,05% Fixed semi-annually from 26/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/10/2024	Citibank	24/10/2023	(902.682)	27.499
USD 50.109.750	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 26/10/2024; and pays 4,55% Fixed semi-annually from 26/4/2024	Citibank	24/10/2023	(1.222.936)	55.363
USD 50.109.751	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,9% Fixed semi-annually from 1/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 1/11/2024	JP Morgan	30/10/2023	(900.122)	18.307
USD 50.109.751	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 1/11/2024; and pays 4,4% Fixed semi-annually from 1/5/2024	JP Morgan	30/10/2023	(923.479)	112.766
USD 20.371.341	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/11/2024; and pays 3,65% Fixed semi-annually from 3/5/2024	Citibank	1/11/2023	109.729	377.913
USD 20.221.990	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 9/11/2024; and pays 4,82% Fixed semi-annually from 9/5/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(295.904)	15.127
USD 20.221.990	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,82% Fixed semi-annually from 9/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/11/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(221.420)	7.472
USD 15.212.544	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	(600.728)	26.583
JPY 1.290.600.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	61.354	134.784
JPY 800.172.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	38.332	83.566
JPY 490.428.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	23.536	51.218
USD 224.135.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,5% Fixed semi-annually from 24/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 24/1/2025	Citibank	22/1/2024	(280.794)	276.181
USD 224.135.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,55% Fixed semi-annually from 26/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/1/2025	Citibank	24/1/2024	(229.201)	309.844
USD 811.582.172	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,45% Fixed semi-annually from 14/8/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/2/2025	Citibank	12/2/2024	(719.558)	1.246.258
EUR 116.920.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/10/2024; and pays 3,37% Fixed annually from 29/7/2025	Citibank	25/7/2024	(56.832)	491.420
EUR 104.380.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 9/11/2024; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/8/2024	JP Morgan	7/8/2024	(28.606)	315.587
EUR 104.300.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 29/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024	JP Morgan	27/8/2024	(30.694)	341.276
USD 6.601.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,235% Fixed semi-annually from 17/12/2026; and pays Floating USD SOFR annually from 17/6/2027	Barclays	15/6/2026	(75.301)	241.712

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD 6.601.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 17/6/2027; and pays 3,235% Fixed semi-annually from 17/12/2026	Barclays	15/6/2026	103.081	420.094
USD 8.059.300	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 22/7/2027; and pays 3,211% Fixed semi-annually from 22/1/2027	Barclays	20/7/2026	128.278	524.594
USD 8.059.300	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,211% Fixed semi-annually from 22/1/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 22/7/2027	Barclays	20/7/2026	(103.989)	292.327
USD 15.473.900	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 22/7/2027; and pays 3,225% Fixed semi-annually from 22/1/2027	Barclays	20/7/2026	237.987	998.336
USD 15.473.900	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,225% Fixed semi-annually from 22/1/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 22/7/2027	Barclays	20/7/2026	(192.025)	568.324
USD 15.359.200	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,582% Fixed semi-annually from 5/2/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 5/8/2027	Barclays	3/8/2026	(27.670)	765.633
USD 15.359.200	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 5/8/2027; and pays 3,582% Fixed semi-annually from 5/2/2027	Barclays	3/8/2026	(3.720)	789.582
USD 54.131.518	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 13/8/2027; and pays 3,63% Fixed semi-annually from 13/2/2027	Barclays	11/8/2026	(127.916)	2.703.162
USD 54.131.518	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,63% Fixed semi-annually from 13/2/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 13/8/2027	Barclays	11/8/2026	(22.821)	2.808.257
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 886.158.173)				(9.986.484)	14.445.694

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (11.639.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,39% Fixed semi-annually from 7/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 7/9/2024	JP Morgan	5/9/2023	(60.189)	(91.963)
USD (11.639.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,605% Fixed semi-annually from 7/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 7/9/2024	Barclays	5/9/2023	(12.566)	(46.028)
USD (302.029.576)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 8/9/2024; and pays 3,6% Fixed semi-annually from 8/3/2024	Morgan Stanley	6/9/2023	1.049.022	(1.250)
USD (102.651.282)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 14/9/2024; and pays 3,3% Fixed semi-annually from 14/3/2024	Citibank	12/9/2023	272.850	(202)
USD (30.539.807)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 15/9/2024; and pays 3,1% Fixed semi-annually from 15/3/2024	Citibank	13/9/2023	58.019	(7)
USD (5.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	2.827	(1.048)
USD (5.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Barclays	20/9/2023	1.379	(1.371)
EUR (8.510.000)	Fund writes a call option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.XO.39.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Morgan Stanley	20/9/2023	(43.114)	(189.969)
USD (51.107.377)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,93% Fixed semi-annually from 4/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 4/10/2024	Goldman Sachs	2/10/2023	20.011	(353.073)
USD (70.648.773)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,5% Fixed semi-annually from 17/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 17/10/2024	Goldman Sachs	13/10/2023	(1.337.933)	(2.069.148)
USD (306.144.689)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,25% Fixed semi-annually from 17/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 17/10/2024	Citibank	13/10/2023	(2.198.915)	(2.849.472)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (156.170.183)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,05% Fixed semi-annually from 18/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/10/2024	Goldman Sachs	16/10/2023	(1.538.095)	(1.979.276)
USD (140.135.656)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,25% Fixed semi-annually from 19/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 19/10/2024	Citibank	17/10/2023	(863.708)	(1.305.135)
USD (29.126.961)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,3% Fixed annually from 23/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 23/10/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	(48.795)	(151.710)
USD (58.253.923)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 23/10/2024; and pays 2,45% Fixed annually from 23/4/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	157.326	(2.873)
USD (200.439.002)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 26/10/2024; and pays 3,09% Fixed semi-annually from 26/4/2024	Citibank	24/10/2023	902.763	(6.939)
USD (103.025.626)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,4% Fixed semi-annually from 30/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 31/10/2024	Goldman Sachs	27/10/2023	197.352	(255.961)
USD (101.856.705)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Citibank	1/11/2023	74.697	(129.017)
USD (20.371.341)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Goldman Sachs	1/11/2023	158.713	(112.226)
USD (408.714.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,8% Fixed semi-annually from 10/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 10/11/2024	Goldman Sachs	8/11/2023	(198.206)	(1.068.767)
USD (307.263.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,85% Fixed semi-annually from 14/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/11/2024	JP Morgan	10/11/2023	(222.658)	(683.553)
USD (60.850.161)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	20.630	(186.684)
USD (152.125.451)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 16/11/2024; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 16/5/2024	Citibank	14/11/2023	522.618	(8.755)
USD (96.200.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,9% Fixed semi-annually from 5/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 5/12/2024	Citibank	1/12/2023	(728.388)	(1.334.448)
USD (16.827.243)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,9% Fixed semi-annually from 15/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/12/2024	JP Morgan	13/12/2023	(92.243)	(210.034)
USD (16.827.243)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 15/6/2024; and pays 2,9% Fixed semi-annually from 15/12/2024	JP Morgan	13/12/2023	124.082	(14.743)
USD (26.051.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 18/12/2024; and pays 2,4% Fixed semi-annually from 18/6/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	466.631	(7.497)
USD (26.051.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 18/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/12/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	(199.941)	(707.935)
JPY (1.290.600.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 24/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 24/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(21.748)	(62.543)
JPY (800.172.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 22/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(13.646)	(38.777)
JPY (490.428.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 22/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(8.388)	(23.766)
USD (51.658.246)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,5% Fixed semi-annually from 9/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/1/2025	Citibank	5/1/2024	115.477	(206.870)
USD (96.200.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 19/1/2025; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 19/7/2024	Citibank	17/1/2024	504.138	(44.202)
USD (224.135.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 24/1/2025; and pays 3,8% Fixed semi-annually from 24/7/2024	Citibank	22/1/2024	143.462	(91.880)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (224.135.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 26/1/2025; and pays 3,85% Fixed semi-annually from 26/7/2024	Citibank	24/1/2024	106.352	(104.335)
USD (811.582.172)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 14/2/2025; and pays 3,75% Fixed semi-annually from 14/8/2024	Citibank	12/2/2024	252.209	(480.002)
USD (149.988.494)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,79% Fixed semi-annually from 1/10/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 1/4/2025	JP Morgan	27/3/2024	(983.860)	(2.530.241)
USD (132.310.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,495% Fixed semi-annually from 29/1/2025; and pays Floating USD SOFR annually from 29/7/2025	JP Morgan	25/7/2024	4.496	(542.606)
EUR (104.380.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 9/8/2025	JP Morgan	7/8/2024	13.024	(102.854)
USD (3.340.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 16/8/2025; and pays 3,7% Fixed semi-annually from 16/2/2025	Nomura	14/8/2024	3.533	(117.625)
USD (3.340.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,7% Fixed semi-annually from 16/2/2025; and pays Floating USD SOFR annually from 16/8/2025	Nomura	14/8/2024	15.163	(105.995)
EUR (104.300.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 29/8/2025	JP Morgan	27/8/2024	(11.564)	(115.265)
USD (31.835.228)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/9/2026; and pays 3,585% Fixed semi-annually from 3/3/2026	Bank of America	29/8/2025	8.238	(1.427.133)
USD (31.835.228)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,585% Fixed semi-annually from 3/3/2026; and pays Floating USD SOFR annually from 3/9/2026	Bank of America	29/8/2025	1.682	(1.433.688)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 1.421.963.896)				(3.387.263)	(21.196.866)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Bermudes			
(1.756.000)	Luye Pharma	HSBC Bank	51.496
			51.496
Îles Caïmans			
(182.600)	iQIYI	Bank of America	112.299
			112.299
Italie			
40.271	Lottomatica	HSBC Bank	(1.005)
			(1.005)
Japon			
(38.000)	Tokyu	HSBC Bank	1.820
			1.820
Corée du Sud			
2.450	SK Hynix	HSBC Bank	(153)
			(153)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.669.175)			164.457

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 268.810.000	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	231.659.963	3,20
USD 562.060.453	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	502.148.260	6,95
USD (159.858.900)	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	(147.551.659)	(2,04)
USD (81.270.396)	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	(77.073.786)	(1,07)
USD 266.003.792	Fannie Mae or Freddie Mac 5,5% TBA	262.784.492	3,64
USD 23.975.000	Fannie Mae or Freddie Mac 6,5% TBA	24.346.173	0,34
USD (87.311.880)	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	(84.680.449)	(1,17)
Total TBA (USD Exposition sous-jacente - USD 1.330.244.781)		711.632.994	9,85

Future Consumer Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Brésil				Royaume-Uni			
78.038	Locaweb Servicios de Internet	115.628	0,89	7.773	CVS	206.923	1,60
				96.617	JD Sports Fashion	179.244	1,38
				5.887	Unilever	304.215	2,35
						690.382	5,33
				États-Unis			
Îles Caïmans				551	Adobe	307.304	2,38
3.303	Sea	126.076	0,97	1.667	Airbnb	219.260	1,70
7.500	Tencent	310.787	2,40	4.853	Amazon.com	668.549	5,16
				10.818	Comcast	511.259	3,95
				1.974	Dollar Tree	239.565	1,85
				226	Equinix*	178.355	1,38
Chine				1.346	Etsy	99.887	0,77
800	Kweichow Moutai	203.097	1,57	1.717	Mastercard	711.662	5,50
				6.408	Match	300.728	2,32
France				170	MercadoLibre	229.840	1,78
1.537	EssilorLuxottica*	293.291	2,27	1.067	Meta Platforms	318.670	2,46
212	Kering	114.648	0,89	3.264	NIKE	334.723	2,59
786	L'Oreal	349.975	2,70	10.956	Pinterest	306.658	2,37
				2.322	ROBLOX	66.037	0,51
				1.629	TJX	150.878	1,16
				2.639	T-Mobile US*	362.308	2,80
				3.031	Uber Technologies	141.790	1,10
				1.637	Visa	404.290	3,12
				2.919	Walt Disney	246.393	1,91
				683	Zebra Technologies	190.352	1,47
				1.671	Zoetis	322.520	2,49
						6.311.028	48,77
				Total des actions ordinaires		12.742.783	98,47
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
						12.742.783	98,47
				Total du portefeuille			
						12.742.783	98,47
				Autres éléments de l'actif net			
						198.448	1,53
				Total de l'actif net (USD)			
						12.941.231	100,00
Allemagne							
5.926	Beiersdorf	781.170	6,04				
5.424	CTS Eventim	338.373	2,61				
3.861	Symrise	404.906	3,13				
						1.524.449	11,78
Inde							
6.815	Reliance Industries	392.544	3,03				
Japon							
8.900	Recruit	317.868	2,46				
7.100	Sony	589.987	4,56				
						907.855	7,02
Pays-Bas							
24.747	Davide Campari-Milano	326.486	2,52				
753	Ferrari*	241.494	1,87				
4.518	Heineken	444.788	3,44				
						1.012.768	7,83
Espagne							
10.121	Cellnex Telecom	390.255	3,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Future Consumer Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Communications	30,58
Biens de consommation non cyclique	27,44
Biens de consommation cyclique	16,91
Finance	10,00
Technologie	4,36
Matériaux de base	3,13
Énergie	3,03
Valeurs industrielles	3,02
Autres éléments de l'actif net	1,53
	100,00

Future Of Transport Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	119.513.812	USD	16.557.757	BNY Mellon	15/9/2023	(121.118)
USD	1.620.625	CNY	11.779.835	BNY Mellon	15/9/2023	560
Moins-value nette non réalisée						(120.558)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	331.531.952	USD	363.677.762	BNY Mellon	15/9/2023	(3.790.119)
USD	34.617.632	EUR	31.714.978	BNY Mellon	15/9/2023	190.186
Moins-value nette non réalisée						(3.599.933)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	10.305.176	USD	13.110.292	BNY Mellon	15/9/2023	(46.278)
USD	1.366.627	GBP	1.076.237	BNY Mellon	15/9/2023	2.266
Moins-value nette non réalisée						(44.012)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	5.746	SGD	7.779	BNY Mellon	5/9/2023	(9)
SGD	9.869.614	USD	7.331.168	BNY Mellon	15/9/2023	(25.954)
USD	747.286	SGD	1.010.906	BNY Mellon	15/9/2023	(956)
Moins-value nette non réalisée						(26.919)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 434.597.193)						(3.791.422)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Technologie	31,71
Valeurs industrielles	26,51
Matériaux de base	18,63
Biens de consommation cyclique	11,48
Communications	5,81
Biens de consommation non cyclique	2,08
Autres éléments de l'actif net	3,78
	100,00

Global Allocation Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				929.135	Suncor Energy*	31.613.144	0,22
				161.385	Teck Resources	6.750.735	0,05
				42.052	TELUS	745.080	0,00
						193.720.964	1,34
COMPARTIMENTS				Îles Caïmans			
Irlande				522.600	Alibaba	6.010.284	0,04
150.000	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻	6.676.500	0,05	96.800	ASMPPT	969.484	0,01
1.474.946	iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF ⁻	13.160.206	0,09	263.350	Baidu	4.680.747	0,03
Total des Compartiments				262.500	CK Asset	1.449.227	0,01
		19.836.706	0,14	107.600	JD Health International*	580.326	0,00
ACTIONS ORDINAIRES / PRIVILEGIEES ET WARRANTS				79.278	JD.com	1.301.930	0,01
Australie				64.680	Lavoro (Wts 27/12/2027)	50.450	0,00
63.078	AGL Energy*	453.125	0,00	187.600	Li Auto	3.865.389	0,03
274.257	BHP	7.967.622	0,05	168.430	Meituan	2.759.571	0,02
17.503	CSL	3.101.173	0,02	4.194.945	Microport Cardioflow Medtech	1.000.200	0,01
300.913	Endeavour*	1.072.043	0,01	513.000	SITC International	956.277	0,01
711.593	Medibank Pvt	1.687.024	0,01	701.900	Tencent	29.085.575	0,20
367.508	Metcash*	887.941	0,01	53.900	Trip.com	2.126.318	0,02
332.908	Origin Energy	1.878.239	0,01	473.000	Want Want China	313.002	0,00
270.012	Qantas Airways	1.033.663	0,01	1.532.000	WH	789.150	0,01
595.950	South32	1.312.494	0,01	Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants			
						55.937.930	0,40
				Chine			
				2.930.000	Agricultural Bank of China	1.004.937	0,01
				10.100	Anhui Gujing Distillery	168.003	0,00
				1.188.000	BYD	37.232.086	0,26
				4.307.000	China Construction Bank	2.306.446	0,01
				365.500	China Merchants Bank	1.444.668	0,01
				7.510.000	China Tower	727.734	0,01
				170.600	COSCO SHIPPING Energy Transportation	310.700	0,00
				270.200	Dongfang Electric	623.194	0,00
				3.307.000	Industrial & Commercial Bank of China	1.517.944	0,01
				103.700	JA Solar Technology	396.678	0,00
				1.659.900	LONGi Green Energy Technology	6.057.486	0,04
				321.840	Ningbo Deye Technology	4.079.097	0,03
				117.400	Nongfu Spring*	659.376	0,01
				2.316.000	PetroChina*	1.671.376	0,01
				144.450	Pharmaron Beijing*	337.045	0,00
				270.000	Shanghai Fosun Pharmaceutical	635.499	0,00
				35.100	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory	1.167.772	0,01
				566.568	Trina Solar	2.646.192	0,02
				Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants			
						62.986.233	0,43
				Curaçao			
				165.799	Schlumberger	9.755.613	0,07
				Danemark			
				1.688	AP Moller - Maersk*	3.097.837	0,02
				26.348	DSV	4.981.188	0,04
				189.102	Novo Nordisk	35.180.523	0,24
				11.472	Novozymes*	497.902	0,00
				Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants			
						43.757.450	0,30
				Finlande			
				32.678	Elisa*	1.611.731	0,01
				32.347	Kesko	634.162	0,01
				71.207	Kone	3.279.504	0,02
				Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants			
						5.525.397	0,04
				France			
				344.387	Accor	12.412.355	0,09
				1.274.816	BNP Paribas	83.055.487	0,57
				144.479	Bolloré	847.243	0,01
				62.608	Carrefour	1.202.974	0,01
				Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants			
						87.538.163	0,44

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
960.680	Cie de Saint-Gobain	62.568.379	0,43	19.320	Linde	7.511.809	0,05
106.802	Dassault Systemes	4.252.587	0,03	63.858	Seagate Technology	4.477.084	0,03
260.016	EssilorLuxottica*	49.616.296	0,34	7.881	Trane Technologies	1.624.432	0,01
4.908	Hermes International	10.209.985	0,07	33.039	Willis Towers Watson	6.899.534	0,05
75.466	Kering*	40.811.329	0,28			36.386.889	0,25
68.690	La Francaise des Jeux SAEM	2.495.093	0,02				
21.440	L'Oreal	9.546.407	0,07		Israël		
81.308	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton*	70.042.493	0,48	186.456	Nice*	36.897.778	0,26
3.542	Remy Cointreau*	555.296	0,00		Italie		
317.167	Sanofi	34.242.269	0,24	306.459	Enel*	2.073.415	0,02
13.755	Schneider Electric	2.379.987	0,02	105.441	FinecoBank Banca Fineco	1.458.571	0,01
33.787	SCOR*	1.055.723	0,01	11.386.019	Intesa Sanpaolo*	30.771.839	0,21
101.275	Societe Generale*	2.894.731	0,02	359.871	Snam*	1.868.257	0,01
7.892	Teleperformance*	1.096.414	0,01	1.085.116	UniCredit*	26.789.266	0,19
332.221	TotalEnergies	20.970.492	0,14			62.961.348	0,44
335.990	Vinci	37.779.967	0,26		Japon		
		448.035.507	3,10	6.700	AGC	234.389	0,00
	Allemagne			50.400	Alfresa*	860.030	0,01
604.248	Bayer	33.381.929	0,23	84.300	Aozora Bank*	1.650.759	0,01
90.709	Bayerische Motoren Werke	9.607.203	0,07	348.200	Astellas Pharma	5.275.831	0,04
10.881	Brenntag*	886.813	0,01	15.800	Bank of Kyoto	910.456	0,01
11.111	Carl Zeiss Meditec	1.121.581	0,01	115.100	BayCurrent Consulting*	3.947.839	0,03
1.097.322	Commerzbank	12.149.402	0,08	700	Capcom	29.422	0,00
30.505	Continental	2.279.008	0,01	47.900	Coca-Cola Bottlers Japan	622.204	0,00
151.017	Dr Ing hc F Porsche*	16.704.015	0,11	10.900	East Japan Railway*	613.929	0,00
50.846	Fresenius	1.639.508	0,01	1.329.500	FANUC	37.777.801	0,26
79.385	LANXESS*	2.517.532	0,02	19.000	Heiwa	288.988	0,00
676.218	Mercedes-Benz	49.822.816	0,34	924.700	Honda Motor*	29.755.157	0,21
34.612	Merck	6.267.449	0,04	256.052	Hoya	28.302.288	0,20
636.022	SAP	89.692.573	0,62	23.800	Ito En	701.681	0,01
49.622	SAP	7.000.176	0,05	2.466.600	Japan Airlines	50.646.697	0,35
16.405	Scout24	1.132.698	0,01	330.100	Japan Post Bank*	2.639.129	0,02
485.115	Siemens	73.337.875	0,51	14.000	Jeol*	445.418	0,00
62.723	Symrise	6.577.812	0,04	41.300	Kakaku.com*	490.271	0,00
849.909	Telefonica Deutschland*	1.628.898	0,01	25.900	Kamigumi*	581.600	0,00
40.938	United Internet*	787.043	0,01	66.700	Kawasaki Heavy Industries*	1.706.348	0,01
33.039	Volkswagen	4.071.333	0,03	135.500	Kawasaki Kisen Kaisha*	4.529.801	0,03
120.519	Zalando	3.798.477	0,03	33.600	Kewpie*	557.835	0,00
		324.404.141	2,24	139.319	Keyence	57.689.354	0,40
	Guernesey			465.900	Komatsu*	13.229.006	0,09
480.079	Genius Sports*	3.202.127	0,02	197.300	Kose*	16.320.738	0,11
	Hong Kong			13.300	Kyocera	680.493	0,01
3.460.600	AIA	31.415.968	0,22	260.800	Lixil*	3.255.651	0,02
146.500	BOC Hong Kong	407.205	0,00	27.300	Mani	354.430	0,00
21.500	BYD Electronic International	99.646	0,00	303.400	Mazda Motor*	3.181.284	0,02
66.800	Hang Seng Bank	851.717	0,01	35.700	Medipal*	609.920	0,00
826.000	Lenovo	934.163	0,01	34.100	MEIJI*	852.063	0,01
221.500	MTR	924.920	0,00	46.400	Mitsubishi Heavy Industries	2.625.487	0,02
		34.633.619	0,24	667.400	Mitsubishi Motors*	2.615.169	0,02
	Inde			8.881.700	Mitsubishi UFJ Financial*	70.704.799	0,49
29.061	Bajaj Auto	1.619.612	0,01	793.400	Mitsui*	29.487.528	0,20
19.433	Eicher Motors	783.224	0,01	118.400	Mitsui OSK Lines*	3.269.560	0,02
81.264	HCL Technologies	1.150.597	0,01	22.900	Money Forward*	859.406	0,00
439.628	Indian Oil	473.157	0,00	29.900	NET One Systems	584.068	0,00
53.648	Kotak Mahindra Bank	1.139.723	0,01	154.200	Nihon M&A Center*	854.692	0,01
17.896	Tata Consultancy Services	725.643	0,00	126.100	Nintendo*	5.407.060	0,04
		5.891.956	0,04	270.000	Nippon Yusen	7.178.818	0,05
	Indonésie			175.800	Nomura Research Institute*	5.033.855	0,04
3.776.800	Bank Central Asia	2.275.255	0,02	5.100	Oracle Japan	354.877	0,00
	Irlande			13.100	Otsuka	582.153	0,00
48.003	Allegion	5.479.062	0,04	207.400	Rakus	3.364.548	0,02
6.644	Aon	2.229.461	0,02	78.000	Santen Pharmaceutical	722.870	0,01
27.705	Johnson Controls International	1.642.906	0,01	112.400	Sega Sammy*	2.236.772	0,02
77.274	Kingspan	6.522.601	0,04	55.600	SG*	800.400	0,01
				6.600	Shimano*	966.371	0,01
				109.200	Shin-Etsu Chemical*	3.480.982	0,03
				99.100	Shiseido	4.011.328	0,03
				57.200	Skylark	797.407	0,01
				70.800	SMC*	34.199.863	0,24

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
80.100	SoftBank*	915.241	0,01				
39.900	Stanley Electric*	698.465	0,00				
18.300	Suzuken*	540.655	0,00				
564.700	Sysmex	29.947.594	0,21				
158.700	Takeda Pharmaceutical*	4.894.938	0,03				
100.800	Terumo*	3.043.553	0,02				
40.300	Tokyo Electron*	5.948.977	0,04				
50.700	TOTO*	1.385.834	0,01				
2.439.600	Toyota Motor*	41.980.057	0,29				
10.000	Yakult Honsha*	522.322	0,00				
223.900	ZOZO*	4.457.166	0,03				
		543.213.627	3,76				
	Jersey						
297.414	Aptiv	30.297.564	0,21				
67.045	Experian	2.365.261	0,02				
13.937	Ferguson*	2.283.491	0,02				
7.005.143	Glencore	37.398.413	0,26				
		72.344.729	0,51				
	Liberia						
52.049	Royal Caribbean Cruises*	5.165.863	0,04				
	Luxembourg						
40.249	ArcelorMittal	1.076.415	0,01				
	Mexique						
158.614	Fomento Economico Mexicano	1.864.548	0,01				
53.742	Grupo Aeroportuario del Sureste	1.557.268	0,01				
231.625	Grupo Financiero Banorte	2.049.063	0,02				
1.831.992	Wal-Mart de Mexico	7.479.911	0,05				
		12.950.790	0,09				
	Pays-Bas						
291.137	ABN AMRO Bank*	4.341.601	0,03				
16.263	Adyen	13.746.802	0,10				
154.386	ASML	102.828.467	0,71				
31.782	BE Semiconductor Industries*	3.703.338	0,03				
315.555	CNH Industrial	4.377.071	0,03				
55.667	Ferrari	17.852.953	0,12				
6.586.334	ING Groep*	94.567.671	0,65				
120.519	Koninklijke Vopak	4.339.809	0,03				
70.943	LyondellBasell Industries	7.051.025	0,05				
15.374	NXP Semiconductors	3.171.195	0,02				
170.215	STMicroelectronics	8.113.650	0,06				
		264.093.582	1,83				
	Norvège						
279.829	Equinor	8.634.883	0,06				
	Arabie Saoudite						
10.393	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services	673.351	0,01				
51.208	Saudi Arabian Oil	476.495	0,00				
144.560	Saudi Telecom	1.534.001	0,01				
		2.683.847	0,02				
	Singapour						
21.100	DBS*	519.807	0,00				
1.971.100	Genting Singapore	1.275.945	0,01				
227.100	Keppel	1.165.982	0,01				
388.100	NETLINK NBN TRUST	248.356	0,00				
96.100	Oversea-Chinese Banking	892.241	0,01				
9.519.143	Seatrium	1.021.130	0,01				
227.900	Singapore Airlines*	1.158.288	0,01				
394.400	Singapore Technologies Engineering	1.111.673	0,00				
777.700	Singapore Telecommunications	1.369.318	0,01				
346.000	Wilmar International	967.572	0,01				
		9.730.312	0,07				
					Afrique du Sud		
17.944	Anglo American Platinum*	628.814	0,00				
17.039	Capitec Bank	1.439.872	0,01				
64.510	Kumba Iron Ore*	1.417.915	0,01				
		3.486.601	0,02				
					Corée du Sud		
142.824	Amorepacific	14.468.798	0,10				
10.204	DB Insurance	630.729	0,00				
16.282	Fila	466.872	0,00				
71.077	GS Engineering & Construction	781.350	0,01				
22.132	Hana Financial	662.244	0,01				
558.543	HD Hyundai Infracore	4.449.750	0,03				
6.739	HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering	630.690	0,00				
28.565	Hyundai Marine & Fire Insurance	653.748	0,00				
129.009	KB Financial	5.280.414	0,04				
27.958	Meritz Financial	1.157.028	0,01				
22.304	NCSOFT	4.243.961	0,03				
13.569	Samsung C&T	1.074.843	0,01				
123.576	Samsung Electronics	6.254.764	0,05				
18.520	Samsung Fire & Marine Insurance	3.453.891	0,02				
283.260	SK Hynix	26.102.567	0,18				
		70.311.649	0,49				
					Espagne		
7.049	Aena SME	1.113.517	0,01				
1.810.699	Cellnex Telecom	69.818.658	0,48				
36.117	Endesa*	758.033	0,01				
83.093	Industria de Diseno Textil	3.204.880	0,02				
		74.895.088	0,52				
					Suède		
567.746	Assa Abloy	12.890.968	0,09				
80.810	Atlas Copco*	1.078.529	0,01				
74.763	Epiroc	1.443.280	0,01				
24.961	Getinge	437.134	0,00				
35.192	Industrivarden	926.798	0,01				
579.291	Nibe Industrier	4.355.339	0,03				
127.369	SKF	2.092.803	0,01				
762.363	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	3.938.567	0,03				
1.802.376	Telia*	3.661.176	0,02				
		30.824.594	0,21				
					Suisse		
653.085	Alcon	54.866.857	0,38				
530	Barry Callebaut*	929.531	0,01				
261.334	Chubb	52.867.868	0,36				
2.828	Cie Financiere Richemont (Wts 22/11/2023)	2.674	0,00				
198.920	Clariant	3.315.299	0,02				
88.031	Coca-Cola HBC	2.572.207	0,02				
4.645	DSM-Firmenich*	429.573	0,00				
4.237	Flughafen Zurich*	879.821	0,00				
2.313	Geberit	1.201.009	0,01				
17.437	Kuehne + Nagel International*	5.249.604	0,04				
50.518	Lonza	28.118.652	0,19				
1.082.954	Nestle*	130.880.118	0,91				
134.695	Novartis	13.664.570	0,09				
83.557	Roche	24.800.999	0,17				
1.934	Swisscom*	1.181.147	0,01				
290.037	TE Connectivity	38.548.818	0,27				
838.996	Transocean*	6.896.547	0,05				
		366.405.294	2,53				
					Taiwan		
312.000	ASE Technology	1.156.044	0,01				
695.000	Chunghwa Telecom	2.531.516	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
1.034.860	Fortive*	81.940.215	0,57	1.073.701	Microsoft†	353.312.051	2,44
982.950	Freeport-McMoRan	39.612.885	0,27	1.755.970	Mirion Technologies	15.066.222	0,11
37.660	General Mills*	2.562.763	0,02	196.836	Mirion Technologies*	1.688.853	0,01
490.401	General Motors	16.448.050	0,11	18.715	Moderna	2.149.418	0,01
89.054	Gilead Sciences	6.842.910	0,04	13.766	Moody's	4.649.467	0,03
19.240	Goldman Sachs	6.353.240	0,05	68.519	Morgan Stanley*	5.848.097	0,04
182.670	Green Plains*	5.693.824	0,04	78.649	Mr Cooper*	4.454.679	0,03
40.053	Halliburton	1.557.261	0,01	3.933	MSCI	2.144.193	0,02
69.306	Hartford Financial Services	4.983.101	0,03	106.851	Nasdaq	5.659.897	0,04
19.944	HCA Healthcare	5.581.927	0,04	3.921	Netflix	1.707.595	0,01
273.470	Healthpeak Properties	5.659.461	0,04	72.100	New York Community Bancorp*	879.620	0,01
3.217	Hershey	696.255	0,00	1.065.811	NextEra Energy	71.974.217	0,50
89.191	Hewlett Packard Enterprise	1.541.666	0,01	102.318	NIKE	10.492.711	0,07
208.391	Hilton Worldwide	31.283.657	0,22	13.078	Nucor	2.242.223	0,02
79.631	Hippo (Wts 2/8/2026)	1.513	0,00	154.780	NVIDIA	76.955.068	0,53
179.100	Humana	84.490.425	0,58	309	NVR	1.962.156	0,01
7.829	Illinois Tool Works*	1.952.240	0,02	155.458	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	3.109	0,00
158.732	Informatica*	3.317.499	0,02	11.670	Omnicom*	941.769	0,01
236.452	Ingersoll Rand	16.527.995	0,11	705	O'Reilly Automotive	664.907	0,00
30.530	Innovid (Wts 31/12/2027)	2.137	0,00	120.628	Otis Worldwide	10.442.766	0,07
7.326	Insulet	1.438.021	0,01	9.549	PACCAR	793.617	0,01
21.452	International Flavors & Fragrances	1.523.736	0,01	98.165	Palo Alto Networks*	23.726.481	0,16
79.417	International Paper	2.772.447	0,02	94.598	Park Hotels & Resorts*	1.223.152	0,01
41.837	Intuit	22.635.072	0,16	23.665	Paycom Software	7.004.840	0,05
129.207	Intuitive Surgical†	41.366.913	0,29	431.980	Peloton Interactive	2.730.114	0,02
265.743	Johnson & Johnson	42.978.615	0,30	83.248	PepsiCo	14.895.565	0,10
477.655	JPMorgan Chase	70.602.186	0,49	595.560	Pfizer	21.380.604	0,15
19.322	Kellogg	1.182.120	0,01	27.250	Phillips 66	3.084.428	0,02
1.008.529	Kenvue	23.377.702	0,16	224.852	Progressive*	30.168.393	0,21
146.156	Keurig Dr Pepper	4.941.534	0,03	41.926	Public Service Enterprise	2.596.058	0,02
60.554	Keysight Technologies	8.059.132	0,06	148.080	Rockwell Automation*	46.230.575	0,31
27.945	Kimberly-Clark	3.625.025	0,03	179.877	Rollins	7.175.294	0,05
137.330	Kinder Morgan	2.384.736	0,02	41.610	RXO*	769.369	0,00
52.150	KLA	26.155.832	0,18	49.449	S&P Global	19.446.314	0,14
13.782	Kraft Heinz	456.873	0,00	269.022	Salesforce	60.971.146	0,42
36.256	Kroger	1.681.916	0,01	5.911	Sarcos Technology & Robotics	6.502	0,00
6.277	Lam Research	4.362.954	0,03	338.691	Sarcos Technology & Robotics (Wts 15/6/2027)	8.501	0,00
93.167	Las Vegas Sands	5.156.794	0,04	167.667	Sarcos Technology & Robotics (Wts 24/9/2026)	4.209	0,00
68.942	Lennar	8.197.893	0,06	36.365	Sealed Air	1.355.687	0,01
88.538	Liberty Media-Liberty Live	2.970.450	0,02	1.151.360	Sempra	82.114.995	0,57
92.150	Liberty Media-Liberty Live*	3.064.909	0,02	2.186	ServiceNow	1.295.599	0,01
354.155	Liberty Media-Liberty SiriusXM	8.687.422	0,06	534.112	Sonder	267.056	0,00
368.601	Liberty Media-Liberty SiriusXM*	8.912.772	0,06	28.679	Southern Copper	2.333.897	0,02
178.087	Lightning Emotors (Wts 15/12/2025)	3.778	0,00	303.988	Starbucks	30.088.732	0,21
101.820	Lincoln National	2.623.901	0,02	607.300	Sun Country	8.927.310	0,06
21.926	Lowe's*	5.064.687	0,03	12.396	Symbotic	493.113	0,00
316.560	LPL Financial	74.002.232	0,51	57.001	Synchrony Financial	1.853.103	0,01
3.921	Lululemon Athletica	1.495.469	0,01	76.926	Tapestry	2.556.251	0,02
62.659	M/I Homes*	6.119.905	0,04	356.024	Tesla	91.580.053	0,64
102.878	Marathon Oil	2.717.008	0,02	16.123	Texas Capital Bancshares	1.002.689	0,01
45.057	Marathon Petroleum	6.382.774	0,04	3.114	Texas Instruments	527.543	0,00
21.092	MarketAxess	5.101.733	0,04	128.393	Thermo Fisher Scientific	72.150.446	0,50
612.669	Marsh & McLennan	120.401.712	0,83	379.250	TJX	35.126.135	0,24
49.863	Marvell Technology	2.916.487	0,02	36.382	Travelers	5.884.425	0,04
91.939	Masco	5.457.499	0,04	258.300	Uber Technologies	12.083.274	0,08
39.394	Masimo*	4.521.840	0,03	693.382	United Airlines	34.599.762	0,23
289.998	Mastercard	120.198.371	0,83	276.223	United Parcel Service	47.532.454	0,33
139.947	McDonald's	39.589.607	0,27	115.781	United States Steel*	3.573.002	0,02
16.165	McKesson	6.774.752	0,05	252.390	UnitedHealth	123.671.100	0,85
3.261	MercadoLibre	4.408.872	0,03	261.825	Valero Energy	33.880.155	0,23
664.263	Merck	73.009.146	0,50	84.920	VeriSign	17.858.676	0,12
37.620	Meritage Homes*	5.201.341	0,04	67.409	Verisk Analytics	16.338.593	0,11
39.583	Meta Platforms	11.821.858	0,08	2.363	Vertex Pharmaceuticals	821.284	0,01
99.706	MetLife	6.318.369	0,04	132.293	Visa*	32.672.402	0,23
4.441	Mettler-Toledo International	5.438.537	0,04	146.549	Vulcan Materials	31.947.682	0,22
174.928	MGM Resorts International*	7.721.322	0,06	108.523	Walgreens Boots Alliance*	2.784.700	0,02
31.962	Microchip Technology	2.634.308	0,02	251.518	Walmart	40.723.279	0,28
488.526	Micron Technology	34.323.837	0,24				

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
556.689	Walt Disney	46.990.118	0,33				
41.987	WEC Energy	3.584.430	0,02				
187.458	Wells Fargo	7.811.375	0,05				
3.520	Wells Fargo	4.075.280	0,03				
32.645	Western Digital	1.483.062	0,01				
109.802	Williams*	3.830.443	0,03				
59.784	Xcel Energy	3.466.276	0,02				
12.043	Yum China	648.154	0,00				
7.564	Yum! Brands	986.648	0,01				
117.940	Zoetis	22.763.599	0,16				
78.600	Zscaler	11.958.204	0,08				
		4.830.847.846	33,39				
Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants				8.308.786.421	57,48		
OBLIGATIONS							
	Argentine						
USD 21.885.365	Argentine Republic Government International Bond 0,75% 9/7/2030	7.391.344	0,05				
USD 2.291.190	Argentine Republic Government International Bond 1% 9/7/2029	748.589	0,00				
USD 26.992.679	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2035*	8.098.749	0,06				
USD 8.980.835	Argentine Republic Government International Bond 4,25% 9/1/2038	3.166.238	0,02				
		19.404.920	0,13				
	Australie						
AUD 328.974.000	Australia Government Bond 1% 21/11/2031	169.183.417	1,17				
	Autriche						
EUR 6.339.000	Benteler International 9,375% 15/5/2028	7.017.184	0,05				
USD 978.000	Klabin Austria 3,2% 12/1/2031	783.847	0,00				
USD 1.331.000	Suzano Austria 3,125% 15/1/2032	1.049.946	0,01				
		8.850.977	0,06				
	Bahamas						
USD 528.000	InterCorp Peru 3,875% 15/8/2029	448.171	0,01				
	Bahreïn						
USD 1.102.000	Bahrain Government International Bond 5,45% 16/9/2032*	991.618	0,01				
USD 850.000	Bahrain Government International Bond 7,5% 20/9/2047*	785.073	0,00				
		1.776.691	0,01				
	Belgique						
GBP 900.000	Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	1.106.740	0,01				
GBP 900.000	KBC 1,25% 21/9/2027	982.674	0,00				
		2.089.414	0,01				
	Bermudes						
USD 453.000	Inkia Energy 5,875% 9/11/2027	436.468	0,00				
USD 1.020.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4,85% 14/10/2038*	897.483	0,01				
		1.333.951	0,01				
	Brésil						
USD 1.105.000	Banco do Brasil 6,25% 18/4/2030*	1.097.431	0,01				
USD 789.000	Banco Votorantim 4,5% 24/9/2024	772.920	0,00				
BRL 404.357.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2024	75.235.235	0,52				
BRL 109.247.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	22.010.371	0,15				
BRL 238.448.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	48.115.124	0,34				
USD 1.305.000	BRF 4,875% 24/1/2030	1.129.302	0,01				
		148.360.383	1,03				
	Îles Vierges britanniques						
USD 514.000	Fortune Star BVI 6,85% 2/7/2024*	469.346	0,00				
USD 900.000	HKT Capital No 6 3% 18/1/2032*	746.060	0,01				
USD 352.000	New Metro Global 4,5% 2/5/2026*	95.311	0,00				
USD 585.000	RKPF Overseas 2020 A 5,2% 12/1/2026	214.590	0,00				
USD 261.078	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033	254.652	0,00				
USD 417.000	Studio City Finance 5% 15/1/2029*	313.732	0,00				
		2.093.691	0,01				
	Canada						
CAD 104.431.000	Canadian Government Bond 0,25% 1/3/2026	69.676.547	0,48				
USD 2.405.000	First Quantum Minerals 6,875% 1/3/2026	2.366.772	0,02				
USD 3.466.000	First Quantum Minerals 6,875% 15/10/2027	3.376.958	0,02				
USD 3.092.000	First Quantum Minerals 7,5% 1/4/2025	3.090.099	0,03				
USD 470.000	First Quantum Minerals 8,625% 1/6/2031	478.828	0,00				
USD 638.000	Garda World Security 7,75% 15/2/2028	637.049	0,00				
USD 6.195.000	Rogers Communications 2,95% 15/3/2025	5.913.364	0,04				
USD 1.632.000	Rogers Communications 3,8% 15/3/2032	1.392.394	0,01				
GBP 900.000	Toronto-Dominion Bank/The 2,875% 5/4/2027*	1.024.269	0,01				
		87.956.280	0,61				
	Îles Caïmans						
USD 828.928	AGL CLO 5 6,988% 20/7/2034	805.681	0,01				
USD 1.153.674	AGL CLO 5 7,288% 20/7/2034	1.140.214	0,01				
USD 725.000	AIMCO CLO Series 2017-A 6,638% 20/4/2034	718.258	0,01				
USD 278.501	AIMCO CLO Series 2018-A 6,97% 17/4/2031	276.288	0,00				
USD 318.000	Allegro CLO IV 7,12% 15/1/2030	315.081	0,00				
USD 250.000	Allegro CLO XI 7,432% 19/1/2033	247.472	0,00				
USD 1.081.525	Apidos CLO XV 6,598% 20/4/2031	1.077.510	0,01				
USD 250.000	Apidos CLO XXXI 7,12% 15/4/2031	247.955	0,00				
USD 400.000	Atrium XIII 7,107% 21/11/2030	396.929	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 279.432	BlueMountain CLO 2014-2 7,338% 20/10/2030	272.650	0,00	USD 590.000	Sands China 4,875% 18/6/2030	515.619	0,00
USD 250.000	Canyon CLO 2020-3 7,27% 15/1/2034	247.281	0,00	USD 640.000	Sands China 5,65% 8/8/2028	602.736	0,01
USD 250.000	CARLYLE US CLO 2018-1 7,088% 20/4/2031	247.193	0,00	USD 2.006.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	2.107.800	0,01
USD 541.794	Catskill Park CLO 6,938% 20/4/2029	544.734	0,01	USD 2.591.000	Seagate HDD Cayman 8,5% 15/7/2031	2.716.161	0,02
USD 692.352	Chenango Park CLO 7,12% 15/4/2030	685.759	0,01	USD 4.030.000	Seagate HDD Cayman 9,625% 1/12/2032	4.468.001	0,03
USD 387.293	CIFC Funding 2017-III 7,388% 20/7/2030	385.388	0,00	USD 3.669.000	Shelf Drilling North Sea 10,25% 31/10/2025	3.684.113	0,02
USD 250.000	CIFC Funding 2018-II 6,628% 20/4/2031	248.937	0,00	USD 1.148.550	Transocean 8,75% 15/2/2030	1.180.305	0,01
USD 405.000	CK Hutchison International 23 4,75% 21/4/2028	394.806	0,00	USD 1.126.000	Transocean Titan Financing 8,375% 1/2/2028	1.158.374	0,01
USD 405.000	CK Hutchison International 23 4,875% 21/4/2033	390.460	0,00	USD 1.075.805	Trinitas CLO XIV 7,613% 25/1/2034	1.063.443	0,01
USD 204.845	Clear Creek CLO 6,788% 20/10/2030	204.050	0,00	USD 627.088	Trinitas CLO XIV 8,613% 25/1/2034	625.800	0,01
USD 692.561	Cook Park CLO 6,97% 17/4/2030	683.921	0,01	USD 249.139	Voya CLO 2013-3 6,721% 18/10/2031	247.990	0,00
USD 1.305.000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	1.299.692	0,01	USD 822.000	Wynn Macau 5,625% 26/8/2028	722.090	0,01
USD 350.000	Fantasia 7,95% 5/7/2022***	16.779	0,00			38.791.718	0,26
USD 399.000	Fantasia 9,25% 28/7/2023***	19.950	0,00		Chili		
USD 319.000	Fantasia 9,875% 19/10/2023	15.950	0,00	USD 1.782.000	Chile Government International Bond 4,34% 7/3/2042*	1.532.573	0,01
USD 352.000	Fantasia 10,875% 9/1/2023***	17.600	0,00	USD 913.000	Empresa Nacional del Petroleo 3,75% 5/8/2026*	858.891	0,01
USD 2.470.000	Fantasia 11,75% 17/4/2022***	123.500	0,00	USD 725.000	Empresa Nacional del Petroleo 6,15% 10/5/2033*	717.627	0,00
USD 956.000	Fantasia 11,875% 1/6/2023***	47.800	0,00	USD 907.000	Engie Energia Chile 3,4% 28/1/2030*	760.220	0,01
USD 250.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 6,608% 20/4/2034	248.203	0,00			3.869.311	0,03
USD 400.000	Goldentree Loan Management US CLO 3 6,888% 20/4/2030	393.247	0,00		Colombie		
USD 1.082.000	IHS 5,625% 29/11/2026	934.350	0,01	USD 3.588.000	Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031*	2.767.245	0,02
USD 778.000	IHS 6,25% 29/11/2028	626.131	0,00	EUR 479.000	Colombia Government International Bond 3,875% 22/3/2026	500.593	0,00
USD 658.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10,875% 15/1/2031	661.981	0,01	USD 1.424.000	Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	1.314.153	0,01
USD 450.000	Madison Park Funding XIII 7,082% 19/4/2030	448.760	0,00	USD 2.315.000	Colombia Government International Bond 4,5% 28/1/2026*	2.234.183	0,02
USD 418.056	Madison Park Funding XLI 6,957% 22/4/2027	416.141	0,00	USD 1.655.000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033*	1.712.859	0,01
USD 275.277	Madison Park Funding XXVI 6,831% 29/7/2030	274.562	0,00	USD 1.784.000	Ecopetrol 4,125% 16/1/2025	1.728.607	0,01
USD 652.000	MAF Global 6,375% 20/3/2026	634.601	0,00	USD 890.000	Ecopetrol 5,875% 28/5/2045	622.462	0,01
USD 758.000	Melco Resorts Finance 5,375% 4/12/2029	634.833	0,01	USD 1.403.000	Ecopetrol 8,875% 13/1/2033	1.420.537	0,01
USD 200.000	MGM China 5,25% 18/6/2025	192.417	0,00	USD 709.000	Promigas / Gases del Pacifico 3,75% 16/10/2029*	598.042	0,00
USD 378.000	MGM China 5,875% 15/5/2026	361.891	0,00	USD 1.693.000	SURA Asset Management 4,875% 17/4/2024*	1.674.385	0,01
USD 250.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6,982% 19/10/2031	245.089	0,00			14.573.066	0,10
USD 292.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 7,038% 20/7/2031	289.691	0,00		Costa Rica		
USD 236.204	Palmer Square CLO 2018-1 6,602% 18/4/2031	235.319	0,00	USD 748.000	Costa Rica Government International Bond 6,55% 3/4/2034	754.698	0,01
USD 370.796	Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 7,439% 23/8/2031	365.823	0,00		Côte d'Ivoire		
USD 653.058	Pikes Peak CLO 1 6,787% 24/7/2031	648.934	0,01	EUR 504.000	Ivory Coast Government International Bond 5,875% 17/10/2031	458.458	0,00
USD 400.000	Pikes Peak CLO 8 6,758% 20/7/2034	397.753	0,00				
USD 241.914	Rockford Tower CLO 2018-1 6,741% 20/5/2031	241.128	0,00				
USD 402.000	Sands China 4,3% 8/1/2026*	376.594	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 3.040.000	Ivory Coast Government International Bond 6,375% 3/3/2028	2.881.282	0,02	EUR 9.782.000	TK Elevator Midco 4,375% 15/7/2027*	9.691.095	0,07
		3.339.740	0,02	EUR 4.900.000	Volkswagen Bank 2,5% 31/7/2026	5.054.035	0,03
				EUR 3.163.000	Volkswagen Financial Services 0,875% 31/1/2028	2.969.332	0,02
						703.210.798	4,87
	République tchèque				Guatemala		
CZK 403.320.000	Czech Republic Government Bond 2,75% 23/7/2029	16.646.356	0,12	USD 1.554.000	Guatemala Government Bond 3,7% 7/10/2033	1.257.318	0,01
CZK 415.750.000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	19.483.396	0,13	USD 579.000	Guatemala Government Bond 4,65% 7/10/2041	456.310	0,00
		36.129.752	0,25	USD 851.000	Guatemala Government Bond 5,25% 10/8/2029	810.816	0,01
				USD 1.505.000	Guatemala Government Bond 5,25% 10/8/2029*	1.433.934	0,01
				USD 725.000	Guatemala Government Bond 6,6% 13/6/2036	728.262	0,00
						4.686.640	0,03
	République dominicaine				Hong Kong		
USD 978.000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6,75% 30/3/2029	956.572	0,01	USD 700.000	AIA 2,7% 7/4/2026*	609.542	0,01
USD 1.861.000	Dominican Republic International Bond 4,5% 30/1/2030	1.627.370	0,01	USD 500.000	AIA 4,95% 4/4/2033	490.407	0,00
USD 3.004.000	Dominican Republic International Bond 4,875% 23/9/2032	2.548.413	0,02	USD 645.000	Bank of East Asia 5,825% 21/10/2025	498.163	0,00
USD 1.631.000	Dominican Republic International Bond 5,95% 25/1/2027	1.596.725	0,01	USD 306.000	Yanlord Land HK 5,125% 20/5/2026	175.185	0,00
USD 1.161.000	Dominican Republic International Bond 6,875% 29/1/2026	1.170.392	0,01			1.773.297	0,01
USD 515.000	Dominican Republic International Bond 7,05% 3/2/2031*	511.722	0,00				
		8.411.194	0,06				
					Hongrie		
	Égypte			USD 1.729.000	Hungary Government International Bond 5,25% 16/6/2029	1.692.553	0,01
USD 978.000	Egypt Government International Bond 7,5% 16/2/2061	495.782	0,01	USD 290.000	Hungary Government International Bond 5,375% 25/3/2024*	289.504	0,00
USD 864.000	Egypt Government International Bond 8,5% 31/1/2047	460.551	0,00			1.982.057	0,01
		956.333	0,01				
					Inde		
	France			USD 210.000	GMR Hyderabad International Airport 4,25% 27/10/2027	187.529	0,00
GBP 900.000	BNP Paribas 1,875% 14/12/2027*	954.029	0,00	USD 470.000	Indian Railway Finance 3,249% 13/2/2030*	407.878	0,00
EUR 2.900.000	BNP Paribas 2,125% 23/1/2027	2.980.655	0,02	USD 300.000	Power Finance 4,5% 18/6/2029	279.174	0,00
GBP 900.000	BNP Paribas 3,375% 23/1/2026	1.069.487	0,01	USD 700.000	REC 2,75% 13/1/2027	633.318	0,01
EUR 5.512.000	Chrome Holdco 5% 31/5/2029	4.723.684	0,03	USD 300.000	REC 5,625% 11/4/2028	296.380	0,00
EUR 9.782.000	Forvia 2,75% 15/2/2027	9.689.609	0,07			1.804.279	0,01
EUR 21.789.000	Picard Groupe 3,875% 1/7/2026*	21.835.204	0,15				
GBP 900.000	Societe Generale 1,875% 3/10/2024*	1.087.990	0,01				
GBP 900.000	TotalEnergies Capital International 1,66% 22/7/2026	1.031.294	0,01				
		43.371.952	0,30				
					Indonésie		
	Allemagne			USD 820.000	Bank Negara Indonesia Persero 3,75% 30/3/2026*	763.686	0,01
EUR 14.568.000	Adler Pelzer 9,5% 1/4/2027	14.481.931	0,10	USD 1.743.000	Freeport Indonesia 4,763% 14/4/2027*	1.681.821	0,01
EUR 6.140.000	APCOA Parking 8,663% 15/1/2027	6.625.924	0,05	USD 3.400.000	Indonesia Government International Bond 4,65% 20/9/2032*	3.289.238	0,02
EUR 365.895.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,7% 15/8/2032*	373.653.691	2,59	IDR 388.189.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2038	27.055.981	0,19
EUR 266.280.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,3% 15/2/2033*	285.148.098	1,97	IDR 294.964.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2036	22.009.581	0,15
EUR 5.377.000	Douglas 6% 8/4/2026	5.586.691	0,04	USD 510.000	Pertamina Geothermal Energy 5,15% 27/4/2028	504.263	0,00
EUR 1	Kirk Beauty SUN 8,25% 1/10/2026	1	0,00	USD 1.813.000	Pertamina Persero 3,65% 30/7/2029*	1.660.874	0,01
				USD 905.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,4% 6/6/2027*	885.742	0,01
						57.851.186	0,40
					Irlande		
				EUR 116.000	Avoca CLO XV 4,713% 15/4/2031	121.400	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 1.524.000	Dell Bank International 0,5% 27/10/2026	1.479.794	0,01	EUR 17.000.000	BK LC Lux Finco1 5,25% 30/4/2029*	17.869.259	0,12
EUR 404.000	Harvest CLO XVIII 4,863% 15/10/2030	426.484	0,00	USD 11.206.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	10.636.893	0,08
EUR 410.000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 5,546% 21/1/2035	433.742	0,00	EUR 7.733.000	Herens Midco 5,25% 15/5/2029	4.516.399	0,03
EUR 280.000	OAK Hill European Credit Partners VI 4,905% 20/1/2032	296.058	0,00	USD 1.014.000	Kenbourne Invest 6,875% 26/11/2024	853.991	0,00
EUR 472.000	OCP Euro CLO 2017-2 5,013% 15/1/2032	502.047	0,01	USD 1.286.081	MC Brazil Downstream Trading 7,25% 30/6/2031*	835.232	0,01
USD 512.813	Prodigy Finance CM2021-1 7,929% 25/7/2051	508.566	0,01	USD 629.996	MC Brazil Downstream Trading 7,25% 30/6/2031	409.145	0,00
USD 298.886	Prodigy Finance CM2021-1 9,179% 25/7/2051	297.426	0,00	USD 573.000	MHP Lux 6,25% 19/9/2029	317.665	0,00
USD 442.484	Prodigy Finance CM2021-1 11,329% 25/7/2051	444.580	0,00	USD 400.000	MHP Lux 6,95% 3/4/2026	234.272	0,00
EUR 250.000	Voya Euro CLO II 5,333% 15/7/2035	263.215	0,00	USD 1.174.500	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028*	1.057.784	0,01
		4.773.312	0,03	USD 1.438.000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	1.324.125	0,01
				USD 202.000	Puma International Financing 5,125% 6/10/2024	200.180	0,00
				EUR 5.376.000	Sani/ikos Finacial 1 5,625% 15/12/2026	5.381.188	0,04
						48.707.647	0,34
	Île de Man				Malaisie		
USD 1.469.000	AngloGold Ashanti 3,75% 1/10/2030	1.221.914	0,01	USD 600.000	CIMB Bank 2,125% 20/7/2027	536.358	0,00
USD 1.070.000	Gohl Capital 4,25% 24/1/2027	997.079	0,01	USD 730.000	Dua Capital 2,78% 11/5/2031	616.857	0,00
		2.218.993	0,02	USD 885.000	Khazanah Capital 4,876% 1/6/2033	863.149	0,01
	Israël			USD 895.000	Khazanah Global Sukuk 4,687% 1/6/2028	881.526	0,01
USD 730.000	Bank Leumi Le-Israel 7,129% 18/7/2033	722.609	0,00	USD 800.000	TNB Global Ventures Capital 4,851% 1/11/2028	784.552	0,01
USD 1.641.000	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033*	1.663.563	0,01			3.682.442	0,03
USD 1.303.000	Leviathan Bond 6,75% 30/6/2030*	1.223.478	0,01		Maurice		
		3.609.650	0,02	USD 223.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	200.308	0,00
	Italie			USD 630.000	Diamond II 7,95% 28/7/2026	620.643	0,00
EUR 13.130.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	13.882.004	0,09	USD 360.000	HTA 7% 18/12/2025	341.647	0,00
EUR 2.005.000	Castor 6% 15/2/2029	1.871.891	0,01	USD 652.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024	642.220	0,01
EUR 6.400.000	Castor 8,776% 15/2/2029	6.567.512	0,05	USD 262.000	India Green Power 4% 22/2/2027	232.090	0,00
EUR 13.500.000	Forno d'Asolo 9,098% 30/4/2027	13.218.702	0,09			2.036.908	0,01
EUR 6.765.000	Marcolin 6,125% 15/11/2026	6.775.198	0,05		Mexique		
EUR 6.914.000	Shiba Bidco 4,5% 31/10/2028*	6.712.848	0,05	USD 815.000	Banco Mercantil del Norte 5,875% 24/1/2027	719.686	0,01
		49.028.155	0,34	USD 1.378.000	Braskem Idesa SAPI 6,99% 20/2/2032*	822.438	0,00
	Japon			USD 1.722.000	Comision Federal de Electricidad 4,875% 15/1/2024	1.711.728	0,01
EUR 1.737.000	Nissan Motor 2,652% 17/3/2026*	1.789.748	0,01	MXN 2.613.200.000	Mexican Bonos 5,75% 5/3/2026	141.314.742	0,98
USD 1.505.000	Rakuten 10,25% 30/11/2024*	1.519.952	0,01	MXN 645.539.900	Mexican Bonos 7,5% 26/5/2033	34.107.684	0,24
EUR 2.758.000	Takeda Pharmaceutical 2,25% 21/11/2026	2.850.272	0,02	MXN 891.090.700	Mexican Bonos 7,75% 29/5/2031	48.475.551	0,33
		6.159.972	0,04	MXN 3.074.136.800	Mexico Cetes 0% 30/5/2024	16.908.722	0,12
	Jersey			MXN 9.485.316.300	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	51.399.968	0,36
USD 1.632.000	Aptiv / Aptiv 3,25% 1/3/2032	1.384.252	0,01	USD 2.175.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	1.801.052	0,01
EUR 3.187.000	Kane Bidco 5% 15/2/2027	3.297.663	0,02	USD 1.601.000	Mexico Government International Bond 3,75% 11/1/2028	1.518.909	0,01
GBP 5.786.000	Kane Bidco 6,5% 15/2/2027	6.709.933	0,04	USD 305.000	Mexico Government International Bond 6,338% 4/5/2053*	304.085	0,00
		11.391.848	0,07				
	Jordanie						
USD 670.000	Jordan Government International Bond 4,95% 7/7/2025	654.205	0,00				
	Luxembourg						
USD 570.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	5.700	0,00				
EUR 4.738.000	Becton Dickinson Euro Finance 3,553% 13/9/2029	5.065.814	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 310.000	Mexico Government International Bond 6,35% 9/2/2035	321.965	0,00	USD 1.644.000	Trivium Packaging Finance 5,5% 15/8/2026	1.553.781	0,01
EUR 343.000	Petroleos Mexicanos 3,75% 21/2/2024	366.859	0,00	GBP 400.000	Volkswagen Financial Services 1,875% 3/12/2024	480.422	0,00
USD 792.000	Petroleos Mexicanos 4,25% 15/1/2025*	749.553	0,01	GBP 400.000	Volkswagen Financial Services 4,25% 9/10/2025	486.991	0,01
USD 1.957.000	Petroleos Mexicanos 5,95% 28/1/2031	1.417.944	0,01	EUR 25.365.000	Ziggo 2,875% 15/1/2030*	22.806.623	0,16
USD 1.631.000	Petroleos Mexicanos 6,5% 13/3/2027*	1.432.671	0,01			95.051.531	0,66
USD 2.251.000	Petroleos Mexicanos 6,7% 16/2/2032	1.704.232	0,01		Nigéria		
USD 1.747.000	Petroleos Mexicanos 8,75% 2/6/2029*	1.563.146	0,01	USD 1.575.000	Nigeria Government International Bond 7,625% 28/11/2047*	1.081.789	0,01
USD 1.205.000	Trust Fibra Uno 4,869% 15/1/2030	1.052.893	0,01	USD 1.050.000	Nigeria Government International Bond 8,375% 24/3/2029	925.323	0,00
		307.693.828	2,13			2.007.112	0,01
	Maroc				Oman		
USD 758.000	Morocco Government International Bond 5,95% 8/3/2028	759.069	0,01	USD 1.631.000	Oman Government International Bond 6,5% 8/3/2047*	1.535.203	0,01
	Pays-Bas			USD 1.957.000	Oman Government International Bond 6,75% 17/1/2048*	1.892.488	0,01
USD 590.000	Braskem Netherlands Finance 7,25% 13/2/2033*	561.392	0,00	USD 781.000	Oman Sovereign Sukuk 4,397% 1/6/2024*	769.101	0,01
USD 652.000	Braskem Netherlands Finance 8,5% 23/1/2081	652.688	0,00	USD 652.000	OQ SAOC 5,125% 6/5/2028	624.427	0,00
GBP 900.000	Cooperatieve Rabobank 1,875% 12/7/2028*	981.725	0,00			4.821.219	0,03
EUR 6.550.000	Dufry One 2,5% 15/10/2024*	6.964.619	0,05		Panama		
USD 1.210.000	Embraer Netherlands Finance 7% 28/7/2030	1.225.367	0,01	USD 652.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5,125% 11/8/2061	489.313	0,00
USD 470.000	Greenko Dutch 3,85% 29/3/2026*	425.453	0,00	USD 2.115.000	Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030*	1.840.610	0,01
EUR 2.800.000	ING Groep 2,125% 23/5/2026	2.926.965	0,02	USD 794.000	Panama Government International Bond 3,875% 17/3/2028	747.539	0,01
GBP 900.000	ING Groep 3% 18/2/2026	1.060.434	0,01	USD 1.802.000	Panama Government International Bond 6,4% 14/2/2035	1.850.490	0,01
USD 829.000	MEGlobal 2,625% 28/4/2028*	732.152	0,01	USD 1.445.000	Panama Government International Bond 6,853% 28/3/2054	1.472.166	0,01
USD 934.000	MEGlobal 2,625% 28/4/2028*	824.885	0,01			6.400.118	0,04
USD 862.000	MEGlobal 4,25% 3/11/2026	827.934	0,01		Paraguay		
EUR 2.863.000	Mercedes-Benz International Finance 1,375% 26/6/2026*	2.935.985	0,02	USD 1.381.000	Paraguay Government International Bond 5,6% 13/3/2048	1.186.804	0,01
USD 652.000	Metinvest 7,65% 1/10/2027	406.027	0,00		Pérou		
USD 840.000	Minejesa Capital 4,625% 10/8/2030*	761.548	0,01	USD 1.732.000	Financiera de Desarrollo 4,75% 15/7/2025*	1.698.685	0,01
USD 1.632.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,4% 1/5/2030	1.431.770	0,01	USD 3.061.000	Peruvian Government International Bond 1,862% 1/12/2032*	2.311.361	0,02
USD 3.738.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4,4% 1/6/2027	3.596.405	0,02	USD 1.606.000	Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031	1.363.486	0,01
USD 2.992.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033*	2.843.926	0,02			5.373.532	0,04
EUR 6.048.000	Sigma Holdco 5,75% 15/5/2026*	5.669.351	0,04		Philippines		
EUR 1.656.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1,875% 31/3/2027	1.545.728	0,01	USD 800.000	Philippine Government International Bond 2,65% 10/12/2045	519.192	0,00
EUR 23.281.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3,75% 9/5/2027	23.152.926	0,16	USD 756.000	Rizal Commercial Banking 6,5% 27/8/2025	692.526	0,00
EUR 5.532.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,375% 15/9/2029	6.161.118	0,04			1.211.718	0,00
EUR 2.893.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,875% 15/9/2031	3.292.718	0,02				
USD 700.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 8,125% 15/9/2031	742.598	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Pologne				ZAR 518.166.988	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026	28.854.860	0,20
EUR 920.000	Republic of Poland Government International Bond 4,25% 14/2/2043	975.706	0,01	USD 1.419.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,85% 30/9/2029*	1.252.225	0,01
USD 692.000	Republic of Poland Government International Bond 4,875% 4/10/2033*	671.887	0,00	USD 2.265.000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	1.506.769	0,01
USD 1.058.000	Republic of Poland Government International Bond 5,5% 4/4/2053	1.031.116	0,01	USD 1.370.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 20/4/2032*	1.215.724	0,01
		2.678.709	0,02			72.280.253	0,50
Roumanie				Corée du Sud			
EUR 1.044.000	Romanian Government International Bond 2,124% 16/7/2031*	862.906	0,01	USD 1.410.000	GS Caltex 5,375% 7/8/2028	1.399.947	0,01
EUR 1.880.000	Romanian Government International Bond 2,5% 8/2/2030	1.707.614	0,01	USD 200.000	Korea National Oil 4,75% 3/4/2026*	196.756	0,00
EUR 1.787.000	Romanian Government International Bond 2,875% 11/3/2029*	1.711.144	0,01	USD 200.000	Korea National Oil 4,875% 3/4/2028	197.562	0,00
USD 1.722.000	Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027	1.692.330	0,01	USD 730.000	LG Chem 2,375% 7/7/2031*	587.474	0,01
		5.973.994	0,04	USD 467.000	POSCO 5,625% 17/1/2026*	467.432	0,00
				USD 504.000	POSCO 5,75% 17/1/2028	507.684	0,00
				USD 200.000	POSCO 5,875% 17/1/2033	206.239	0,00
				USD 750.000	SK Hynix 2,375% 19/1/2031	581.539	0,01
				USD 1.900.000	SK Hynix 6,375% 17/1/2028	1.922.743	0,01
						6.067.376	0,04
Arabie Saoudite				Espagne			
USD 2.008.000	Saudi Government International Bond 4,5% 17/4/2030*	1.959.838	0,01	USD 777.333	Al Candelaria Spain 7,5% 15/12/2028*	722.360	0,00
USD 1.523.000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053*	1.356.041	0,01	GBP 3.100.000	Banco Santander 3,125% 6/10/2026	3.636.338	0,03
		3.315.879	0,02	EUR 2.700.000	Banco Santander 3,625% 27/9/2026	2.894.917	0,02
				EUR 188.861.000	Spain Government Bond 2,55% 31/10/2032	191.276.710	1,32
				EUR 18.049.000	Spain Government Bond 2,9% 31/10/2046	16.497.879	0,12
				EUR 165.320.000	Spain Government Bond 3,15% 30/4/2033	174.903.280	1,21
				EUR 13.935.000	Spain Government Bond 3,45% 30/7/2066	13.211.390	0,09
				EUR 18.712.000	Spain Government Bond 3,9% 30/7/2039	20.361.384	0,14
				GBP 1.800.000	Telefonica Emisiones 5,375% 2/2/2026	2.252.801	0,02
						425.757.059	2,95
Sénégal				Suède			
USD 1.022.000	Senegal Government International Bond 6,25% 23/5/2033*	838.357	0,01	GBP 900.000	Swedbank 1,375% 8/12/2027	974.361	0,01
				EUR 16.053.000	Verisure 3,25% 15/2/2027*	15.705.094	0,11
				EUR 1.603.000	Verisure 3,875% 15/7/2026	1.642.417	0,01
				EUR 1.660.000	Verisure 7,125% 1/2/2028*	1.824.728	0,01
				EUR 3.262.000	Verisure 9,25% 15/10/2027	3.773.804	0,03
				EUR 9.192.000	Verisure Midholding 5,25% 15/2/2029*	8.711.754	0,06
						32.632.158	0,23
Singapour				Suisse			
USD 250.000	ABJA Investment 5,45% 24/1/2028	245.602	0,00	USD 3.048.000	Credit Suisse 2,95% 9/4/2025	2.893.688	0,02
USD 500.000	BOC Aviation 3,5% 18/9/2027*	466.845	0,00	USD 3.025.000	Credit Suisse 5% 9/7/2027	2.939.206	0,02
USD 745.000	Continuum Energy Aura 9,5% 24/2/2027	740.820	0,00	USD 2.777.000	Credit Suisse 7,95% 9/1/2025	2.831.047	0,02
USD 500.000	DBS 3,3% 27/2/2025	474.533	0,00	EUR 5.840.000	UBS 0,65% 14/1/2028	5.607.684	0,04
USD 836.784	LLPL Capital 6,875% 4/2/2039*	742.960	0,01			14.271.625	0,10
USD 1.882.000	Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	1.853.839	0,01				
USD 656.000	Theta Capital 8,125% 22/1/2025	529.746	0,01				
USD 200.000	TML 4,35% 9/6/2026	184.562	0,00				
		5.238.907	0,03				
Afrique du Sud				Thaïlande			
ZAR 238.000.884	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	11.365.670	0,08	USD 372.000	Bangkok Bank 3,733% 25/9/2034	316.390	0,00
ZAR 24.577.105	Republic of South Africa Government Bond 8,25% 31/3/2032	1.111.333	0,01	USD 500.000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025*	473.500	0,00
ZAR 99.876.273	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 31/1/2044*	3.868.651	0,02				
ZAR 566.637.510	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040*	23.105.021	0,16				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 550.000	GC Treasury Center 2,98% 18/3/2031	437.660	0,00	GBP 83.525.396	United Kingdom Gilt 0,5% 22/10/2061	31.308.473	0,22
USD 564.000	Kasikornbank 3,343% 2/10/2031	506.097	0,01	GBP 160.970.000	United Kingdom Gilt 1,25% 22/7/2027*	180.620.103	1,25
USD 262.000	Krung Thai Bank 4,4% 25/3/2026	238.420	0,00	USD 1.161.000	Vedanta Resources Finance II 8,95% 11/3/2025	761.558	0,01
USD 600.000	Minor International 2,7% 19/4/2026	547.770	0,01	USD 500.000	Vedanta Resources Finance II 13,875% 21/1/2024*	430.375	0,00
USD 201.000	Muang Thai Life Assurance 3,552% 27/1/2037	178.608	0,00	GBP 9.782.000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	11.327.539	0,08
		2.698.445	0,02			328.489.979	2,28
Ukraine				États-Unis			
USD 2.397.000	Ukraine Government International Bond 7,253% 15/3/2035	649.132	0,01	USD 2.640.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	2.328.909	0,02
USD 978.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2025	317.850	0,00	EUR 2.771.000	AbbVie 1,375% 17/5/2024	2.950.299	0,02
USD 1.370.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2026	399.355	0,00	USD 9.155.000	AbbVie 2,6% 21/11/2024	8.827.840	0,06
USD 1.079.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding 6,2% 11/2/2025	798.460	0,01	USD 988.959	AccessLex Institute 5,953% 25/5/2036	961.461	0,01
		2.164.797	0,02	USD 1.206.000	Affinity Interactive 6,875% 15/12/2027	1.070.637	0,01
				USD 425.000	Alexander Funding Trust II 7,467% 31/7/2028	429.662	0,00
Émirats arabes unis				USD 1.769.000	Allegiant Travel 7,25% 15/8/2027	1.733.275	0,01
USD 341.000	Abu Dhabi National Energy 4,696% 24/4/2033	335.032	0,00	USD 11.736.000	Allegiant Travel 8,5% 5/2/2024	11.762.054	0,08
USD 1.002.000	MDGH GMTN RSC 4,375% 22/11/2033	947.391	0,01	EUR 7.005.000	American Tower 0,45% 15/1/2027	6.679.904	0,05
		1.282.423	0,01	USD 6.695.000	American Tower 5,25% 15/7/2028	6.590.216	0,05
Royaume-Uni				USD 1.632.000	Amgen 2% 15/1/2032	1.281.036	0,01
EUR 3.106.000	Barclays 0,877% 28/1/2028	2.987.188	0,02	USD 1.605.000	Amgen 2,3% 25/2/2031	1.325.714	0,01
GBP 900.000	Barclays 3% 8/5/2026	1.043.698	0,01	USD 4.943.000	Amgen 3,35% 22/2/2032	4.315.730	0,03
GBP 900.000	Barclays 3,25% 12/2/2027	1.024.514	0,01	USD 9.986.000	Amgen 5,15% 2/3/2028	9.968.629	0,07
EUR 11.535.000	BCP V Modular Services Finance 6,75% 30/11/2029	9.316.675	0,07	GBP 900.000	Amgen 5,5% 7/12/2026*	1.135.152	0,01
GBP 8.806.000	BCP V Modular Services Finance II 6,125% 30/11/2028	9.181.507	0,06	USD 970.000	Amkor Technology 6,625% 15/9/2027	970.940	0,01
GBP 1.643.000	BG Energy Capital 5,125% 1/12/2025	2.057.830	0,01	EUR 9.782.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028*	8.815.156	0,06
GBP 4.935.000	Boparan Finance 7,625% 30/11/2025	4.214.036	0,03	USD 5.690.000	AREIT 2022-CRE7 7,556% 17/6/2039	5.692.237	0,04
EUR 3.586.000	BP Capital Markets 2,519% 7/4/2028	3.693.092	0,03	USD 305.000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	311.091	0,00
GBP 9.803.000	Deuce Finco 5,5% 15/6/2027	10.694.543	0,07	GBP 1.770.000	AT&T 2,9% 4/12/2026	2.032.327	0,01
GBP 1.000.000	HSBC 1,75% 24/7/2027	1.114.570	0,01	GBP 900.000	AT&T 5,5% 15/3/2027*	1.112.370	0,01
EUR 2.773.000	HSBC 3,019% 15/6/2027	2.895.567	0,02	USD 842.000	Azul Investments 5,875% 26/10/2024	774.640	0,01
EUR 3.233.000	INEOS Finance 3,375% 31/3/2026*	3.316.936	0,02	USD 756.000	Azul Secured Finance 11,93% 28/8/2028*	752.866	0,01
EUR 3.111.000	INEOS Finance 6,625% 15/5/2028*	3.350.844	0,02	USD 460.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3,716% 14/4/2033	409.741	0,00
USD 6.536.000	INEOS Finance 6,75% 15/5/2028*	6.248.216	0,05	USD 1.210.000	BANK 2017-BNK9 3,538% 15/11/2054	1.112.828	0,01
GBP 900.000	Informa 3,125% 5/7/2026	1.051.949	0,00	USD 783.000	Bank of America 1,898% 23/7/2031	618.706	0,00
GBP 4.843.000	Inspired Entertainment Financing 7,875% 1/6/2026	5.858.175	0,04	USD 2.317.000	Bank of America 1,922% 24/10/2031	1.816.090	0,01
GBP 1.800.000	Lloyds Banking 2,25% 16/10/2024	2.186.590	0,01	EUR 2.844.000	Bank of America 1,949% 27/10/2026	2.939.246	0,02
GBP 5.895.000	Marks & Spencer 3,75% 19/5/2026*	6.925.115	0,05	USD 3.641.000	Bank of America 2,496% 13/2/2031	3.028.660	0,02
EUR 4.020.000	National Grid 0,163% 20/1/2028*	3.706.789	0,02	USD 2.552.000	Bank of America 2,592% 29/4/2031	2.124.558	0,01
GBP 900.000	NatWest 2,875% 19/9/2026	1.054.898	0,01	USD 189.655	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 6,129% 25/11/2035	173.068	0,00
GBP 900.000	NatWest 3,125% 28/3/2027	1.045.274	0,01				
GBP 18.068.000	Punch Finance 6,125% 30/6/2026*	20.010.909	0,14				
GBP 900.000	Santander UK 3,625% 14/1/2026	1.063.016	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 209.101	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5,769% 25/10/2036	194.651	0,00	USD 593.946	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6,409% 15/5/2035	592.015	0,00
USD 2.951.000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6,629% 15/3/2037	2.252.295	0,02	USD 1.200.964	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6,906% 15/5/2035	1.178.059	0,01
EUR 2.217.000	Becton Dickinson 0,034% 13/8/2025*	2.232.814	0,02	USD 5.354.649	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7,606% 15/5/2035	5.219.043	0,04
USD 3.692.000	Becton Dickinson 3,7% 6/6/2027	3.493.155	0,02	USD 1.341.475	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 6,811% 19/12/2030	1.330.248	0,01
USD 610.912	BHMS 2018-ATLS 6,857% 15/7/2035	600.449	0,00	USD 1.010.000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 7,211% 19/12/2030	999.874	0,01
USD 1.715.558	BHMS 2018-ATLS 7,507% 15/7/2035	1.648.765	0,01	USD 2.204.000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	2.171.451	0,01
USD 2.648.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	2.636.468	0,02	USD 2.884.000	Dell International / EMC 5,25% 1/2/2028	2.874.596	0,02
USD 4.247.000	Broadcom 1,95% 15/2/2028	3.682.664	0,03	USD 3.327.000	DISH Network 0% 15/12/2025	2.158.859	0,02
USD 1.870.000	Broadcom 2,45% 15/2/2031	1.508.360	0,01	EUR 2.798.000	Duke Energy 3,1% 15/6/2028	2.888.106	0,02
USD 1.605.000	Broadcom 4,15% 15/11/2030	1.467.767	0,01	USD 3.652.000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027*	3.728.345	0,03
USD 2.289.000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3,875% 15/1/2027	2.173.310	0,01	USD 8.288.000	Elevance Health 3,65% 1/12/2027	7.813.173	0,05
USD 2.281.200	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,633% 10/3/2033	2.058.903	0,01	USD 2.968.000	Elevance Health 4,9% 8/2/2026	2.927.326	0,02
USD 5.393.000	Calumet Specialty Products Partners / Calumet Finance 9,75% 15/7/2028	5.373.358	0,04	USD 2.034.000	Emerald Debt Merger Sub 6,625% 15/12/2030	2.001.582	0,01
USD 860.545	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 7,575% 15/12/2037	849.869	0,01	USD 655.000	EQM Midstream Partners 7,5% 1/6/2027	661.357	0,00
USD 1.986.000	Carrols Restaurant 5,875% 1/7/2029	1.710.939	0,01	USD 700.000	EQM Midstream Partners 7,5% 1/6/2030	718.691	0,00
USD 527.428	CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3,911% 13/11/2050	426.692	0,00	USD 3.245.000	Equinix 1% 15/9/2025	2.959.600	0,02
USD 1.661.000	CDI Escrow Issuer 5,75% 1/4/2030	1.552.099	0,01	USD 3.387.000	Equinix 1,55% 15/3/2028	2.858.997	0,02
USD 670.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	679.048	0,00	USD 2.335.000	Equinix 2,9% 18/11/2026	2.156.997	0,01
EUR 2.840.000	Citigroup 1,25% 6/7/2026	2.922.547	0,02	USD 11.876.000	EquipmentShare.com 9% 15/5/2028	11.812.530	0,08
GBP 1.372.000	Citigroup 1,75% 23/10/2026	1.538.160	0,01	USD 1.055.346	Fannie Mae-Aces 3,866% 25/9/2030	995.763	0,01
USD 2.148.000	Citigroup 2,561% 1/5/2032	1.730.854	0,01	EUR 2.958.000	Fidelity National Information Services 1,5% 21/5/2027	2.945.996	0,02
USD 3.264.000	Citigroup 2,572% 3/6/2031	2.697.681	0,02	USD 35.443.780	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0,941% 25/5/2029	1.220.241	0,01
USD 2.979.000	Citigroup 2,666% 29/1/2031	2.497.590	0,02	USD 31.539.450	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,132% 25/10/2030	1.756.634	0,01
USD 802.000	Citigroup 3,98% 20/3/2030	737.209	0,01	USD 4.873.647	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,528% 25/7/2030	360.140	0,00
USD 1.223.900	Citigroup CCommercial Mortgage Trust 2018-C6 4,412% 10/11/2051	1.154.155	0,01	USD 22.579.134	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,644% 25/1/2030	1.723.621	0,01
USD 6.657.000	Civitas Resources 8,375% 1/7/2028	6.843.419	0,05	USD 9.628.434	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,697% 25/4/2030	776.541	0,01
USD 3.330.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	2.978.560	0,02	USD 5.508.048	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,813% 25/4/2030	465.644	0,00
EUR 1.666.000	Comcast 0,25% 14/9/2029	1.481.746	0,01	USD 1.530.711	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 8,688% 25/1/2042	1.521.151	0,01
USD 2.220.256	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3,528% 10/12/2047	2.154.477	0,02	USD 2.204.000	Freedom Mortgage 8,125% 15/11/2024	2.195.856	0,02
USD 1.270.000	Concentrix 6,6% 2/8/2028	1.243.544	0,01	USD 1.102.000	Freedom Mortgage 8,25% 15/4/2025	1.085.740	0,01
USD 2.580.000	Concentrix 6,65% 2/8/2026	2.581.773	0,02	USD 3.945.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027*	3.594.929	0,02
EUR 8.101.000	Coty 3,875% 15/4/2026*	8.549.461	0,06				
USD 644.000	Coty/HFC Prestige Products/ HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030	642.198	0,00				
USD 2.696.000	Crown Castle 2,9% 15/3/2027	2.473.245	0,02				
USD 402.545	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust 4,798% 15/11/2048	362.059	0,00				
USD 4.695.000	CSC 5,25% 1/6/2024	4.459.794	0,03				
USD 5.958.000	CSC 5,5% 15/4/2027	5.141.846	0,04				
USD 771.000	DAE Funding 1,55% 1/8/2024	737.747	0,01				
USD 390.000	DAE Funding 2,625% 20/3/2025*	367.023	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 5.945.000	Frontier Communications 8,625% 15/3/2031	5.708.053	0,04	USD 13.761.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	13.535.747	0,09
USD 7.070.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	6.863.538	0,05	USD 1.752.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	1.526.813	0,01
USD 6.385.000	Frontier Florida 6,86% 1/2/2028	5.955.481	0,04	EUR 3.595.000	Morgan Stanley 1,342% 23/10/2026*	3.659.722	0,03
USD 3.810.000	Frontier North 6,73% 15/2/2028	3.475.349	0,02	USD 866.000	Morgan Stanley 2,239% 21/7/2032	681.292	0,00
USD 6.367.781	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7,894% 17/8/2037	6.399.632	0,05	USD 327.000	Morgan Stanley 2,699% 22/1/2031	275.267	0,00
USD 254.000	Full House Resorts 8,25% 15/2/2028*	226.223	0,00	USD 4.538.000	Morgan Stanley 3,62% 17/4/2025*	4.468.347	0,03
USD 823.000	GCI 4,75% 15/10/2028	714.878	0,01	USD 6.196.000	Morgan Stanley Bank 4,754% 21/4/2026	6.108.558	0,04
USD 662.000	Gen Digital 6,75% 30/9/2027	662.350	0,00	USD 395.094	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4,468% 15/5/2048	337.984	0,00
USD 4.602.000	Gen Digital 7,125% 30/9/2030	4.642.746	0,04	USD 2.057.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 3,72% 15/12/2049	1.920.011	0,01
EUR 4.691.000	General Mills 0,125% 15/11/2025	4.698.851	0,03	USD 1.299.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	1.121.315	0,01
EUR 3.663.000	General Mills 0,45% 15/1/2026	3.667.807	0,03	EUR 1.984.000	Nasdaq 4,5% 15/2/2032	2.190.158	0,02
USD 3.325.000	General Motors Financial 5,4% 6/4/2026	3.285.772	0,02	USD 3.024.000	Nationstar Mortgage 5,125% 15/12/2030	2.554.728	0,02
EUR 1.377.000	Global Payments 4,875% 17/3/2031	1.494.405	0,01	USD 3.475.000	Nationstar Mortgage 5,5% 15/8/2028	3.161.816	0,02
EUR 3.236.000	Goldman Sachs 0,25% 26/1/2028*	2.975.936	0,02	USD 428.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	408.059	0,00
USD 3.244.000	Goldman Sachs 1,093% 9/12/2026	2.910.176	0,02	EUR 5.362.000	Netflix 3,625% 15/5/2027*	5.743.972	0,04
USD 3.264.000	Goldman Sachs 1,992% 27/1/2032	2.544.031	0,02	USD 2.974.000	Netflix 4,875% 15/4/2028	2.927.415	0,02
USD 2.407.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	1.949.570	0,01	USD 1.384.000	New Home 8,25% 15/10/2027	1.325.533	0,01
GBP 900.000	Goldman Sachs 7,25% 10/4/2028*	1.187.029	0,01	USD 3.562.000	Northern States Power 4,5% 1/6/2052	3.079.680	0,02
USD 3.602.965	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2,1% 20/5/2048	2.753.806	0,02	USD 2.805.000	NRG Energy 7% 15/3/2033	2.771.284	0,02
USD 11.074.000	GoTo 5,5% 1/9/2027	6.488.079	0,04	USD 1.968.000	Olympus Water US 7,125% 1/10/2027*	1.841.453	0,01
USD 667.000	GrafTech Global Enterprises 9,875% 15/12/2028	647.244	0,00	USD 11.580.000	Olympus Water US 9,75% 15/11/2028	11.675.442	0,08
USD 4.197.000	HCA 3,5% 1/9/2030	3.668.003	0,03	USD 2.070.000	Oncor Electric Delivery 4,1% 15/11/2048	1.698.321	0,01
USD 5.133.000	HCA 5,375% 1/2/2025	5.099.319	0,04	USD 5.974.000	ONEOK Partners 4,9% 15/3/2025	5.878.754	0,04
USD 4.011.000	HCA 5,625% 1/9/2028	4.000.578	0,03	USD 4.065.000	Oracle 2,3% 25/3/2028	3.576.406	0,02
USD 546.920	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust 3,076% 10/8/2038	449.649	0,00	USD 5.808.000	Oracle 2,875% 25/3/2031	4.908.741	0,04
USD 1.684.000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3,911% 10/7/2035	1.567.875	0,01	USD 2.571.000	Oracle 2,95% 1/4/2030	2.227.320	0,02
EUR 2.721.000	International Business Machines 3,375% 6/2/2027	2.920.202	0,02	USD 133.000	Pacific Gas and Electric 3,25% 16/2/2024	131.375	0,00
USD 772.280	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-WPT 8,055% 5/7/2033	651.596	0,00	USD 3.248.000	Pacific Gas and Electric 3,3% 1/12/2027	2.892.602	0,02
GBP 2.250.000	JPMorgan Chase 0,991% 28/4/2026	2.632.462	0,02	USD 1.265.000	Pacific Gas and Electric 6,1% 15/1/2029	1.249.732	0,01
EUR 2.960.000	JPMorgan Chase 1,09% 11/3/2027	2.974.253	0,02	USD 1.632.000	Pacific Gas and Electric 6,4% 15/6/2033	1.615.297	0,01
USD 3.264.000	JPMorgan Chase 1,764% 19/11/2031	2.555.470	0,02	USD 545.000	Palomino Funding Trust I 7,233% 17/5/2028	552.012	0,00
GBP 549.000	Kraft Heinz Foods 4,125% 1/7/2027	658.327	0,01	USD 3.600.000	Paramount Global 6,375% 30/3/2062	2.977.740	0,02
USD 1.333.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	1.220.443	0,01	USD 2.957.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 5,75% 24/5/2026	2.935.157	0,02
USD 2.048.000	Lightning eMotors 7,5% 15/5/2024	921.600	0,01	USD 557.000	Periama 5,95% 19/4/2026*	531.244	0,00
USD 10.668.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	6.456.850	0,04	USD 8.963.000	Pitney Bowes 6,875% 15/3/2027*	6.797.539	0,05
USD 1.632.000	Lowe's 2,625% 1/4/2031	1.370.350	0,01	EUR 2.739.000	PPG Industries 1,875% 1/6/2025	2.866.646	0,02
USD 7.438.000	Lowe's 4,8% 1/4/2026	7.347.950	0,05	EUR 1.884.000	Procter & Gamble 4,875% 11/5/2027*	2.147.617	0,02
				USD 1.025.000	Prologis 2,25% 15/1/2032	823.230	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 1.357.000	Rain Carbon 12,25% 1/9/2029	1.403.125	0,01	USD 18.000.000	United States Treasury Bill 0% 3/10/2023*	17.915.146	0,12
USD 6.812.000	Rand Parent 8,5% 15/2/2030*	6.503.172	0,05	USD 50.000.000	United States Treasury Bill 0% 5/10/2023	49.750.352	0,34
USD 9.475.028	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7,867% 25/10/2039	9.481.628	0,07	USD 118.000.000	United States Treasury Bill 0% 10/10/2023	117.325.680	0,81
USD 3.745.000	Regal Rexnord 6,05% 15/2/2026	3.726.594	0,03	USD 100.000.000	United States Treasury Bill 0% 12/10/2023	99.396.104	0,69
USD 4.173.000	RingCentral 8,5% 15/8/2030	4.116.936	0,03	USD 1.186.000	United States Treasury Bill 0% 14/11/2023	1.173.161	0,01
USD 5.325.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	5.239.326	0,03	USD 18.591.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2027	18.560.540	0,13
USD 728.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	717.893	0,00	USD 111.120.200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,5% 15/4/2024*,†	131.528.176	0,91
USD 3.656.000	Sabre GLBL 11,25% 15/12/2027	3.487.683	0,02	USD 178.516.800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/1/2024*	230.262.646	1,59
USD 326.000	Sasol Financing USA 4,375% 18/9/2026	292.147	0,00	USD 61.108.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/7/2032	57.608.859	0,40
USD 1.272.000	Sasol Financing USA 6,5% 27/9/2028*	1.154.664	0,02	USD 22.961.000	United States Treasury Note/ Bond 2,375% 15/2/2042*,†	17.077.244	0,12
USD 1.796.000	Sasol Financing USA 8,75% 3/5/2029*	1.762.325	0,01	USD 55.520.200	United States Treasury Note/ Bond 3,25% 15/5/2042†	47.402.539	0,33
USD 558.000	Service Properties Trust 4,35% 1/10/2024	537.279	0,00	USD 27.945.800	United States Treasury Note/ Bond 3,375% 15/8/2042†	24.253.898	0,17
USD 1.723.000	Service Properties Trust 4,5% 15/3/2025	1.633.856	0,01	USD 219.770.000	United States Treasury Note/ Bond 4% 30/6/2028*,†	216.894.103	1,50
USD 2.654.000	Service Properties Trust 7,5% 15/9/2025	2.635.240	0,02	USD 292.652.100	United States Treasury Note/ Bond 4% 31/7/2028*	290.525.801	2,01
USD 562.000	SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	424.681	0,00	USD 43.135.600	United States Treasury Note/ Bond 4% 15/11/2052*,†	41.649.444	0,29
USD 860.000	SK Battery America 2,125% 26/1/2026	771.411	0,01	USD 4.006.000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	3.992.792	0,03
USD 7.349.990	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10,175% 15/10/2041	7.778.304	0,05	USD 2.381.000	USB Capital IX 6,59% 2/10/2023	1.794.226	0,01
USD 7.193.108	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2,99% 15/1/2053	5.984.472	0,04	GBP 900.000	Verizon Communications 1,125% 3/11/2028*	903.057	0,01
USD 1.499.000	Southern California Edison 1,1% 1/4/2024	1.458.033	0,01	USD 7.003.000	Verizon Communications 2,55% 21/3/2031	5.762.606	0,04
USD 3.584.000	Southern California Edison 5,3% 1/3/2028	3.593.986	0,03	GBP 238.000	Verizon Communications 4,073% 18/6/2024	297.718	0,00
USD 6.575.000	Spirit AeroSystems 7,5% 15/4/2025*	6.497.468	0,04	EUR 2.587.000	Verizon Communications 4,25% 31/10/2030	2.835.561	0,02
USD 715.000	Spirit AeroSystems 9,375% 30/11/2029	744.729	0,01	USD 395.000	Viasat 5,625% 15/9/2025	373.062	0,00
USD 5.513.000	Sprint 7,875% 15/9/2023	5.509.334	0,04	USD 3.568.000	Viasat 5,625% 15/4/2027	3.188.731	0,02
USD 1.360.625	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4,738% 20/3/2025	1.346.808	0,01	USD 1.550.000	Vistra Operations 5,125% 13/5/2025	1.510.824	0,01
USD 324.000	Steel Dynamics 5% 15/12/2026	317.887	0,00	USD 7.002.000	Vistra Operations 5,625% 15/2/2027	6.746.716	0,05
USD 526.000	Stem 0,5% 1/12/2028	321.148	0,00	USD 3.286.000	VMware 1,4% 15/8/2026	2.909.765	0,02
USD 4.256.000	Tenneco 8% 17/11/2028	3.502.092	0,02	USD 1.632.000	VMware 2,2% 15/8/2031	1.272.809	0,01
EUR 2.978.000	Thermo Fisher Scientific 1,375% 12/9/2028	2.902.688	0,02	USD 1.350.000	VNDO Trust 2016-350P 4,033% 10/1/2035	1.180.037	0,01
USD 3.787.000	T-Mobile USA 2,7% 15/3/2032	3.084.392	0,02	EUR 2.955.000	Wells Fargo 1,375% 26/10/2026	2.947.013	0,02
USD 2.434.000	T-Mobile USA 3,5% 15/4/2031	2.126.114	0,01	EUR 4.515.000	Wells Fargo 1,5% 24/5/2027	4.458.955	0,03
USD 2.579.000	T-Mobile USA 4,95% 15/3/2028	2.540.518	0,02	USD 5.938.000	Wells Fargo 4,808% 25/7/2028	5.758.568	0,04
USD 2.919.915	Topaz Solar Farms 5,75% 30/9/2039	2.763.685	0,02	USD 2.000.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28 3,872% 15/5/2048	1.877.353	0,01
USD 217.000.000	United States Treasury Bill 0% 5/9/2023	216.873.958	1,50	USD 796.545	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 3,903% 15/7/2050	660.664	0,00
USD 94.000.000	United States Treasury Bill 0,00% 12/9/2023	93.849.532	0,65				
USD 50.000.000	United States Treasury Bill 0% 19/9/2023	49.868.219	0,34				
USD 116.000.000	United States Treasury Bill 0% 21/9/2023	115.660.055	0,80				
USD 72.000.000	United States Treasury Bill 0% 28/9/2023	71.714.542	0,50				

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.318.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3,874% 15/6/2036	1.114.821	0,01	2.463	Inde Think & Learn Pvt**	1.860.851	0,01
USD 2.226.000	Welltower 4% 1/6/2025	2.157.191	0,01	3.482	Think & Learn Pvt**	2.630.727	0,02
USD 175.000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5,5% 1/3/2025	172.781	0,00			4.491.578	0,03
USD 9.250.000	Xerox 5% 15/8/2025	8.828.061	0,06	413.408	Royaume-Uni 10X Future Technologies**	7.955.180	0,06
		2.550.837.981	17,65				
USD 1.774.000	Uruguay Uruguay Government International Bond 5,75% 28/10/2034*	1.905.728	0,01	63.622	États-Unis Aiven**	5.370.333	0,04
Total des obligations		5.376.205.649	37,18	21.376	Breeze Aviation**	6.730.234	0,05
BILLET DE TRÉSORERIE				188.149	ByteDance**	32.679.567	0,23
France				45.635	Caresyntax**	4.360.424	0,03
USD 12.174.000	Societe Generale 0% 6/3/2024	11.813.984	0,08	6.574	Caresyntax**	526.906	0,00
Allemagne				5.179	Caresyntax (Wts 21/6/2033)**	494.802	0,00
USD 33.182.000	Bayer 0% 1/9/2023	33.171.944	0,23	488.757	Databricks**	26.104.511	0,18
Suisse				136.950	Databricks**	7.314.499	0,05
USD 8.710.000	UBS (London Branch) 0% 18/6/2024	8.307.701	0,06	1.209.710	Deep Instinct**	8.528.455	0,06
USD 8.710.000	UBS (London Branch) 0% 25/6/2024	8.298.307	0,06	82.654	Deep Instinct (Wts 20/9/2032)**	491.791	0,00
		16.606.008	0,12	1.172.341	Deep Instinct Series D-4**	8.265.004	0,06
États-Unis				24.969	Epic Games**	16.342.710	0,11
USD 16.241.000	3M 0% 7/9/2023	16.221.958	0,11	941.683	eXo Imaging**	2.467.209	0,02
USD 31.041.000	AT&T 0% 19/12/2023	30.501.484	0,21	420.195	Fanatics**	30.527.167	0,21
USD 5.475.000	AT&T 0% 20/12/2023	5.378.949	0,04	157.436	Farmer's Business Network**	3.838.290	0,03
USD 33.182.000	AT&T 0% 23/1/2024	32.416.289	0,22	23.814	Farmer's Business Network**	580.585	0,00
USD 42.335.000	AT&T 0% 21/2/2024	41.156.206	0,28	25.662	FLYR (Wts 31/12/2049)**	348.233	0,00
USD 6.130.000	Enel Finance America 0% 6/9/2023	6.123.498	0,04	235.953	GM Cruise**	4.990.406	0,03
USD 9.580.000	General Motors 0% 22/11/2024	9.354.040	0,06	144.403	Hawkeye 360 (Wts 7/7/2033)**	651.257	0,01
USD 7.052.000	General Motors 0% 25/1/2024	6.882.109	0,05	22.921	Hawkeye 360 ATM (Wts 7/7/2033)**	52.718	0,00
USD 10.895.000	General Motors Financial 0% 10/10/2023	10.824.124	0,08	57.303	Hawkeye 360 MGR (Wts 7/7/2033)**	258.437	0,00
USD 5.748.000	HSBC USA 0% 20/11/2023	5.675.048	0,04	448.109	Hawkeye 360 Series D1**	4.041.943	0,03
USD 5.750.000	HSBC USA 0% 24/6/2024	5.462.455	0,04	6.145.462	Included Health**	7.067.281	0,05
USD 9.025.000	HSBC USA 0% 1/7/2024	8.562.424	0,06	3.924.026	JumpCloud**	10.202.468	0,07
USD 8.630.000	HSBC USA 0% 12/8/2024	8.123.787	0,06	258.097	JumpCloud**	671.052	0,00
Total des billets de trésorerie		248.274.307	1,72	216.912	Latch (Wts 4/6/2026)	-	0,00
CERTIFICATS DE DÉPÔT				592.242	Lessen**	5.300.566	0,04
États-Unis				206.148	Lessen Series C**	1.845.025	0,01
USD 22.730.000	Citibank (New York Branch) 5% 21/9/2023	22.721.561	0,16	760.471	Loadsmart**	8.502.066	0,06
Total des certificats de dépôt		22.721.561	0,16	95.378	Loadsmart**	1.066.326	0,01
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				107.909	Lookout**	280.563	0,00
		13.975.824.644	96,68	1.919.121	Lookout Series F**	8.827.957	0,06
Autres titres négociables				231.287	Mountain Digital**	2.444.703	0,02
ACTIONS ORDINAIRES / PRIVILEGIEES ET WARRANTS				561.098	Mythic**	6	0,00
Australie				4.980	NCB Warrant**	-	0,00
9.488.465	Quintis Pty**	61	0,00	24.103	Neon Payments**	12.397.860	0,09
Îles Caïmans				652.238	NMC Health**	-	0,00
609	Marco Polo Investment**	-	0,00	750.669	Noodle**	3.903.479	0,03
Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants				129.448	Psiquantum**	3.650.434	0,03
				261.161	Relativity Space**	4.147.237	0,03
				3.662	Salt Pay**	2.124.253	0,01
				134.315	SambaNova Systems**	10.660.582	0,07
				46.362	SambaNova Systems**	3.679.752	0,03
				167.805	Snorkel AI**	1.579.045	0,01
				46.853	Snorkel AI**	440.887	0,00
				337.227	Source Global**	9.557.013	0,06
				24.317	Source Global**	923.560	0,01
				1.121.246	Ursa Major Technologies**	3.576.775	0,02
				137.361	Ursa Major Technologies Series D**	454.665	0,00
				1.197.196	Verge Genomics**	7.733.886	0,05
				178.954	Versa Networks (Wts 7/10/2032)**	493.913	0,01
				1.451.933	Versa Networks Series E**	4.500.992	0,03
						280.997.827	1,94
						293.444.646	2,03

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Global Allocation Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
NOK	741.622.471	CHF	62.231.601	Goldman Sachs	20/9/2023	(904.789)
NOK	108.370.078	USD	9.855.709	Deutsche Bank	14/9/2023	324.181
NZD	12.625.121	USD	7.713.696	JP Morgan	20/9/2023	(204.628)
PLN	61.210.000	USD	14.687.463	Bank of America	14/9/2023	164.427
PLN	94.943.874	USD	22.824.802	Barclays	20/9/2023	204.557
SGD	13.869.490	USD	10.329.617	JP Morgan	14/9/2023	(64.288)
SGD	37.493.709	USD	27.998.635	JP Morgan	20/9/2023	(240.579)
THB	894.222.200	USD	25.889.467	HSBC Bank	14/9/2023	(327.682)
THB	703.665.000	USD	20.410.185	Citigroup	14/9/2023	(295.573)
TWD	1.613.158.500	USD	52.520.218	State Street	20/9/2023	(1.857.572)
USD	130.737.035	HKD	1.020.337.188	UBS	20/9/2023	539.804
USD	24.992.725	CZK	551.019.440	Deutsche Bank	14/9/2023	151.558
USD	89.447.767	MXN	1.580.080.930	JP Morgan	14/9/2023	(4.803.498)
USD	24.692.737	ZAR	476.550.643	State Street	14/9/2023	(646.865)
USD	17.884.337	IDR	266.222.658.292	UBS	14/9/2023	406.275
USD	46.145.257	INR	3.819.835.139	Citigroup	20/9/2023	6.030
USD	1.836.244	EUR	1.696.498	State Street	14/9/2023	(5.254)
USD	19.874.482	SEK	213.859.133	Deutsche Bank	20/9/2023	255.486
USD	30.318.705	NOK	326.441.556	Deutsche Bank	20/9/2023	(351.852)
USD	66.244.835	CNH	470.298.580	BNP Paribas	20/9/2023	1.548.592
USD	475.818	EUR	438.375	Royal Bank of Canada	14/9/2023	(25)
USD	507.156	EUR	464.812	Citigroup	14/9/2023	2.616
USD	36.882.838	MXN	644.626.024	Goldman Sachs	20/9/2023	(1.528.804)
USD	44.323.303	ZAR	840.338.982	Citigroup	14/9/2023	(359.996)
USD	9.344.257	IDR	139.703.177.381	Morgan Stanley	14/9/2023	172.457
USD	180.773.545	AUD	262.728.302	Bank of America	20/9/2023	10.490.624
USD	94.361.190	BRL	460.831.743	Morgan Stanley	20/9/2023	1.069.599
USD	188.606.890	GBP	147.852.501	Deutsche Bank	20/9/2023	1.168.025
USD	1.088.863.677	EUR	992.660.030	Barclays	20/9/2023	11.047.381
USD	235.196.879	JPY	32.596.993.885	Morgan Stanley	20/9/2023	11.594.499
USD	12.993.007	BRL	63.509.688	HSBC Bank	14/9/2023	123.409
USD	7.511.759	ZAR	139.081.633	Société Générale	20/9/2023	120.288
USD	88.110.110	MXN	1.543.431.583	Citigroup	20/9/2023	(3.859.093)
USD	37.095.897	BRL	178.485.713	Goldman Sachs	20/9/2023	962.935
USD	103.865.023	EUR	93.746.426	JP Morgan	20/9/2023	2.076.472
USD	10.274.039	SGD	13.869.490	Citigroup	14/9/2023	8.709
USD	46.227.632	INR	3.802.685.000	Barclays	14/9/2023	294.923
USD	36.887.003	JPY	5.257.264.790	Citigroup	20/9/2023	824.263
USD	66.240.699	GBP	51.538.539	JP Morgan	20/9/2023	903.114
USD	44.601.794	GBP	34.113.967	Citigroup	20/9/2023	1.354.077
USD	29.837.765	EUR	26.459.191	Bank of America	20/9/2023	1.108.748
USD	29.709.094	NOK	298.071.341	Bank of America	20/9/2023	1.704.038
USD	10.758.236	NOK	108.370.078	Barclays	14/9/2023	578.346
USD	103.950.587	MXN	1.771.422.798	HSBC Bank	20/9/2023	(1.604.039)
USD	33.034.625	CZK	725.472.783	Barclays	14/9/2023	328.720
USD	12.002.031	HUF	4.202.283.000	Bank of America	14/9/2023	38.178
USD	20.775.095	BRL	99.436.459	JP Morgan	14/9/2023	625.299
USD	373.946	EUR	336.528	Morgan Stanley	14/9/2023	8.655
ZAR	722.340.081	USD	38.508.579	Morgan Stanley	20/9/2023	(119.931)
ZAR	182.326.000	USD	10.121.575	HSBC Bank	14/9/2023	(426.764)
BRL	18.177.000	USD	3.714.747	Barclays	14/9/2023	(31.361)
CLP	4.873.925.000	USD	5.621.597	BNP Paribas	14/9/2023	75.997
CLP	3.229.345.000	USD	3.732.190	Barclays	14/9/2023	42.898
CLP	3.229.345.000	USD	3.741.132	JP Morgan	14/9/2023	33.957
COP	39.017.305.000	USD	8.889.794	BNP Paribas	17/5/2024	95.459
COP	30.779.837.000	USD	7.433.131	Citigroup	14/9/2023	37.685
COP	30.756.444.000	USD	7.402.095	BNP Paribas	29/9/2023	25.612
HUF	1.982.864.000	USD	5.615.747	Citigroup	14/9/2023	29.445

Global Allocation Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
IDR	199.747.050.676	USD	13.027.265	Deutsche Bank	14/9/2023	86.537
INR	2.429.474.500	USD	29.281.361	JP Morgan	20/9/2023	63.905
INR	770.819.000	USD	9.333.079	BNP Paribas	14/9/2023	(22.341)
SEK	859.500.000	USD	79.036.883	UBS	20/9/2023	(188.125)
USD	29.960.488	IDR	455.597.560.240	Morgan Stanley	20/9/2023	52.226
USD	11.587.710	IDR	176.654.645.000	Citigroup	14/9/2023	(10.028)
USD	10.156.538	BRL	49.635.000	Goldman Sachs	14/9/2023	98.506
USD	13.420.500	PLN	54.854.000	JP Morgan	14/9/2023	110.820
USD	14.777.041	MXN	256.165.500	Citigroup	14/9/2023	(503.139)
USD	18.371.256	MXN	313.605.794	Barclays	14/9/2023	(335.219)
USD	17.101.040	CNH	123.974.000	Citigroup	14/9/2023	51.948
USD	10.165.124	EUR	9.290.000	Goldman Sachs	14/9/2023	81.102
USD	10.165.640	CNH	73.910.000	JP Morgan	14/9/2023	1.425
USD	10.024.761	COP	40.575.220.000	Citigroup	14/9/2023	176.431
USD	9.336.517	COP	39.017.305.000	BNP Paribas	17/10/2023	(38.803)
USD	5.692.755	THB	201.700.000	BNP Paribas	14/9/2023	(72.940)
USD	43.561.630	JPY	6.344.799.327	Royal Bank of Canada	20/9/2023	38.837
USD	25.989.992	BRL	129.040.545	Citigroup	14/9/2023	(158.773)
USD	49.847.229	JPY	7.250.608.449	Barclays	20/9/2023	110.946
ZAR	328.749.000	USD	17.427.248	Citigroup	14/9/2023	53.305
Moins-value nette non réalisée						(35.217.796)
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	271.883.860	USD	177.066.646	BNY Mellon	15/9/2023	(881.761)
USD	6.292.130	AUD	9.758.716	BNY Mellon	15/9/2023	(31.641)
Moins-value nette non réalisée						(913.402)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	27.663.274	USD	31.673.211	BNY Mellon	15/9/2023	(314.063)
USD	1.060.227	CHF	929.498	BNY Mellon	15/9/2023	6.551
Moins-value nette non réalisée						(307.512)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	226.979.016	USD	31.442.335	BNY Mellon	15/9/2023	(226.095)
USD	3.648.668	CNY	26.360.827	BNY Mellon	15/9/2023	23.288
Moins-value nette non réalisée						(202.807)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	1.687.048.350	USD	1.850.973.592	BNY Mellon	15/9/2023	(19.633.013)
USD	68.176.842	EUR	62.480.681	BNY Mellon	15/9/2023	352.424
Moins-value nette non réalisée						(19.280.589)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	114.920.136	USD	146.219.045	BNY Mellon	15/9/2023	(533.216)
USD	6.237.980	GBP	4.905.498	BNY Mellon	15/9/2023	19.212
Moins-value nette non réalisée						(514.004)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	227.917.464	USD	29.197.710	BNY Mellon	15/9/2023	(121.974)
USD	5.094.268	HKD	39.915.123	BNY Mellon	15/9/2023	2.252
Moins-value nette non réalisée						(119.722)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	3.384.849.727	USD	23.755.069	BNY Mellon	15/9/2023	(553.936)
USD	778.500	JPY	112.869.772	BNY Mellon	15/9/2023	4.869
Moins-value nette non réalisée						(549.067)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	38.315.487	USD	9.432.003	BNY Mellon	15/9/2023	(135.796)
USD	328.435	PLN	1.344.839	BNY Mellon	15/9/2023	2.145
Moins-value nette non réalisée						(133.651)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	89.964.376	USD	66.832.427	BNY Mellon	15/9/2023	(243.278)
USD	2.296.124	SGD	3.110.614	BNY Mellon	15/9/2023	(6.259)
Moins-value nette non réalisée						(249.537)
Catégorie d'Actions couverte en ZAR						
USD	158	ZAR	3.023	BNY Mellon	15/9/2023	(2)
ZAR	90.902	USD	4.821	BNY Mellon	15/9/2023	12
Plus-value nette non réalisée						10
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 9.451.760.978)						(57.488.077)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
2.019	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	254.164.226	(175.284)
(69)	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	9.990.978	206.617
(625)	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	78.597.501	(212.801)
358	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	49.603.891	(438.904)
536	JPY	Nikkei 225 Index	Septembre 2023	119.775.330	915.213
(288)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	289.566.612	1.219.132
87	CAD	S&P/TSX 60 Index	Septembre 2023	15.737.532	292.152
39	EUR	Dax Index	Septembre 2023	16.988.615	(196.755)
92	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	4.328.975	(9.482)
(916)	GBP	FTSE 100 Index	Septembre 2023	87.064.332	1.419.527
437	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	21.528.805	(475.497)
(1.561)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	Septembre 2023	485.986.130	(12.090.665)
(165)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	Septembre 2023	15.808.650	(246.675)
2.947	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	668.342.762	15.678.683
1.657	EUR	EURO STOXX Banks Index	Septembre 2023	10.125.851	777.529
(85)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	10.332.812	(107.588)
432	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	47.904.750	263.977
(153)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	17.745.609	(182.154)
(2.076)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	268.777.125	(6.227.116)
514	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	62.114.368	521.055
(467)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	49.877.789	(240.784)
Total				2.584.362.643	690.180

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 305.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2024	(8.538)	7.910
CDS	USD 605.000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Barclays	20/6/2024	(4.354)	24.255
CDS	USD 764.388	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2027	(24.104)	(11.834)
CDS	USD 390.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2027	44.586	131.895
CDS	USD 985.000	Fund receives default protection on Borgwarner; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2027	(27.596)	(15.765)
CDS	USD 540.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/12/2027	58.394	182.624
CDS	USD 990.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2025	(49.119)	107.270

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 220.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	22.612	74.402
CDS	USD 320.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	30.620	108.221
CDS	USD 380.000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	(11.080)	27.114
CDS	USD 615.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(49.441)	66.637
CDS	USD 70.511.631	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.37; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2026	23.029	(1.080.643)
CDS	USD (15.189.391)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.39.V1; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	583.922	503.805
CDS	USD (36.892.177)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.39.V1; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	505.183	564.748
CDS	EUR (15.833.329)	Fund provides default protection on ITRAXX.XO.38.V1; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	1.410.892	844.816
CDS	USD 4.340.000	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	(88.346)	(128.413)
CDS	USD 390.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	44.537	131.895
CDS	USD 630.000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	(18.555)	44.952
CDS	USD 1.580.000	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	6.191	73.594
CDS	USD 342.657	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	2.002	15.960
CDS	USD 318.672	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	1.863	14.843
CDS	USD 3.260.000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(88.844)	(16.574)
CDS	USD 3.255.000	Fund receives default protection on Southwest Airlines; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(53.181)	(5.954)
CDS	EUR 9.900.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(450.892)	(110.929)
CDS	EUR 5.840.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(258.681)	(65.437)
CDS	USD 764.389	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(24.104)	(11.834)
CDS	USD 1.021.223	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(31.184)	(15.811)
CDS	USD 1.260.000	Fund receives default protection on Ford Motor; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	(85.560)	(113.492)
CDS	USD 570.000	Fund receives default protection on Ford Motor; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	(25.065)	(52.019)
CDS	USD (33.871.714)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.33.V1; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2024	(325.304)	312.769
IFS	EUR 11.180.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,693%	Goldman Sachs	15/8/2032	(255.712)	(255.712)
IRS	BRL 154.497.000	Fund receives Fixed 9,98%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2026	(77.728)	(77.728)
IRS	BRL 22.044.207	Fund receives Fixed 11,5625%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	117.764	117.764
IRS	BRL 33.551.158	Fund receives Fixed 11,82%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	223.489	223.489
IRS	BRL 22.095.109	Fund receives Fixed 11,27%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	2/1/2026	89.439	89.439
IRS	BRL 113.105.027	Fund receives Fixed 9,965%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(206.038)	(206.038)
IRS	BRL 701.231.454	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(23.854)	(23.854)
IRS	BRL 17.029.082	Fund receives Fixed 11,76%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	107.926	107.926
IRS	BRL 110.099.446	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(210.841)	(210.841)
IRS	BRL 165.268.000	Fund receives Fixed 10,1075%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	2/1/2026	1.313	1.313
IRS	KRW 27.526.486.255	Fund receives Fixed 3,3725%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2026	(163.329)	(163.329)
IRS	KRW 27.526.486.256	Fund receives Fixed 3,384%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2026	(156.561)	(156.561)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	KRW 27.522.357.489	Fund receives Fixed 3,391%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2026	(152.419)	(152.419)
IRS	ZAR 592.884.931	Fund receives Floating ZAR JIBAR 3 Month; and pays Fixed 8,22%	Goldman Sachs	20/9/2026	(265.598)	(265.598)
IRS	BRL 141.437.775	Fund receives Fixed 10,005%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(292.061)	(292.061)
IRS	GBP 51.315.000	Fund receives Fixed 4,86%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Goldman Sachs	20/6/2028	83.902	83.902
IRS	EUR 60.014.000	Fund receives Fixed 2,34%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Goldman Sachs	19/1/2033	(1.066.070)	(1.066.070)
IRS	MXN 775.152.164	Fund receives Fixed 8,17%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Goldman Sachs	10/6/2033	(1.821.757)	(1.821.757)
IRS	USD 99.369.997	Fund receives Fixed 3,7565%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	9/8/2033	(592.403)	(592.403)
IRS	ZAR 225.749.716	Fund receives Fixed 9,895%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	462.398	462.398
IRS	ZAR 112.874.858	Fund receives Fixed 9,896%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	231.595	231.595
IRS	ZAR 112.874.857	Fund receives Fixed 9,9175%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	240.114	240.114
IRS	USD 13.573.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,613%	Goldman Sachs	2/5/2042	2.051.741	2.082.647
IRS	BRL 17.779.514	Fund receives Fixed 11,775%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2026	114.119	114.119
IRS	BRL 109.845.909	Fund receives Fixed 10,025%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	(159.051)	(159.051)
IRS	BRL 31.266.700	Fund receives Fixed 11,83%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2026	209.958	209.958
IRS	BRL 109.964.132	Fund receives Fixed 9,99%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	4/1/2027	(183.201)	(183.201)
TRS	USD 15.259.000	Fund receives iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	(108.739)	(144.651)
TRS	USD 15.915.247	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	(122.742)	(139.106)
TRS	USD 166.890	Fund receives JPM EMBIG DIV CORE + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 75bps	JP Morgan	20/9/2023	(857.258)	(857.258)
TRS	USD 8.152.304	Fund receives USD SOFR 1 Day + 0bps; and pays iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bps	JP Morgan	20/9/2023	72.909	91.905
TRS	USD 25.000.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	(33.727)	(58.008)
TRS	USD 10.000.000	Fund receives USD SOFR 1 Day + 0bps; and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	15.346	37.968
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 1.116.503.228)					(1.617.193)	(1.122.104)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
36.612.000	Put	OTC USD/INR	Citibank	USD 82	9/10/2023	(30.443)	45.893
145.392.721	Put	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,099	25/9/2023	1.087.434	2.309.796
120.773.063	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16,6	12/9/2023	(364.840)	259.557
2.820.300	Put	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1,06	20/10/2023	488.060	957.535
80.640.000	Call	OTC USD/HKD	Morgan Stanley	USD 7,81	13/11/2023	38.344	187.206
1.992.995	Call	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 239,439	10/11/2023	17.355	147.178
3.320.329	Call	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 239,3	10/11/2023	23.662	246.734
1.329.992	Call	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 239,43	10/11/2023	22.559	98.257
6.555	Call	NASDAQ 100 Index	UBS	USD 15.700	15/9/2023	(295.539)	907.303
416	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	(232.917)	42.432

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
697	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	(664.749)	5.925
358	Put	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 15	15/9/2023	(9.800)	4.475
270	Put	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 12,5	15/9/2023	(15.480)	5.400
330	Call	Albemarle	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(195.402)	14.850
1.239	Call	Alibaba	Exchange Traded	USD 100	15/9/2023	(542.023)	89.827
564	Put	Ally Financial	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(21.279)	7.050
1.496	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	1.357.277	1.974.720
1.672	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	819.083	1.417.020
1.330	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(167.884)	615.125
1.384	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	15/9/2023	(477.025)	86.500
1.842	Call	Apple	Exchange Traded	USD 195	15/9/2023	(839.453)	144.597
832	Call	Apple	Exchange Traded	USD 200	15/9/2023	(335.022)	22.880
1.958	Call	Apple	Exchange Traded	USD 205	15/9/2023	(520.297)	22.517
522	Call	Applied Materials	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	370.353	657.720
1.288	Call	Archer-Daniels-Midland	Exchange Traded	USD 82,5	15/9/2023	(170.311)	51.520
4.313	Call	Barclays	Exchange Traded	GBP 1,6	15/9/2023	(183.872)	13.668
493	Put	Crowdstrike	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(260.664)	9.121
4.326	Call	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(578.512)	10.815
826	Call	Edwards Lifesciences	Exchange Traded	USD 85	15/9/2023	(223.524)	8.260
187	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	1.039.008	1.314.610
245	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	1.827.850	2.203.775
289	Call	First Solar	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(231.651)	21.819
5.768	Call	Ford Motor	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(295.331)	5.768
1.730	Call	General Motors	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(263.730)	4.325
331	Call	Humana	Exchange Traded	USD 450	15/9/2023	520.995	830.810
83	Call	Humana	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	13.421	132.385
2.497	Call	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	(477.398)	8.740
1.728	Call	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 60	15/9/2023	(438.069)	23.328
729	Call	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 62,5	15/9/2023	(184.454)	4.739
4.031	Call	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(716.426)	18.140
671	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 360	15/9/2023	(696.624)	17.111
979	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 355	15/9/2023	(1.155.108)	39.649
1.252	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 365	15/9/2023	(1.266.208)	21.910
1.251	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	5.504.739	8.628.772
89	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	9.719	238.742
89	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 485	15/9/2023	(60.039)	210.040
747	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(730.569)	1.155.982
427	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 470	15/9/2023	351.323	1.447.530
412	Put	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 210	15/9/2023	(438.514)	4.944
2.503	Call	Pfizer	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(399.802)	6.258
3.069	Call	Pfizer	Exchange Traded	USD 42,5	15/9/2023	(321.395)	4.604
522	Put	PG&E	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(6.123)	2.088
633	Put	PG&E	Exchange Traded	USD 14	15/9/2023	(8.143)	1.583
159	Put	RingCentral	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(4.926)	1.590
429	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 5	15/9/2023	3.808	12.656
175	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 230	15/9/2023	(151.542)	56.437
175	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 240	15/9/2023	(133.680)	14.175
238	Put	Seagate Technology	Exchange Traded	USD 57,5	15/9/2023	(10.219)	714
233	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	15/9/2023	(32.499)	1.049
2.182	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	(1.521.081)	94.917
378	Call	Starbucks	Exchange Traded	USD 105	15/9/2023	(96.551)	3.213
1.340	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(10.358)	10.050
565	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 17	15/9/2023	(10.017)	4.238
132	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 275	15/9/2023	(121.885)	45.870
132	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 280	15/9/2023	(199.949)	33.990
502	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 290	15/9/2023	(881.627)	70.782
830	Call	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	(16.375)	251.075
2.773	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(551.076)	70.711
1.058	Call	UniCredit	Exchange Traded	EUR 23	15/9/2023	(226.886)	202.312

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
541	Call	United Rentals	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	116.650	1.311.925
319	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 120	15/9/2023	136.459	319.000
1.661	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	377.364	971.685
1.294	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(371.029)	39.467
149	Put	Viasat	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(9.123)	2.608
80	Put	Viasat	Exchange Traded	USD 22,5	15/9/2023	(1.678)	800
729	Call	Vinci	Exchange Traded	EUR 110	15/9/2023	(161.384)	6.327
416	Call	Walt Disney	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	(114.698)	6.448
412	Put	Zscaler	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(170.869)	184.370
565	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 25	20/9/2023	(30.922)	7.628
82	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 108,5	22/9/2023	(19.986)	8.328
1.641	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	118.595	635.887
8.706	Call	Alibaba	Exchange Traded	USD 110	20/10/2023	(1.599.554)	831.423
347	Put	Ally Financial	Exchange Traded	USD 23	20/10/2023	(8.851)	9.543
2.468	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	438.786	1.789.300
985	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 140	20/10/2023	98.766	480.187
1.974	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(614.638)	573.447
987	Call	Apple	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	767.074	1.149.855
1.317	Call	Apple	Exchange Traded	USD 185	20/10/2023	620.011	1.056.892
829	Call	Bunge	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	607.502	978.220
2.468	Call	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 125	20/10/2023	(152.350)	445.474
313	Call	Equitrans Midstream	Exchange Traded	USD 12	20/10/2023	(11.340)	1.565
823	Put	Fortinet	Exchange Traded	USD 55	20/10/2023	(174.665)	49.380
2.496	Call	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 45	20/10/2023	(535.632)	142.272
2.007	Call	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(229.253)	61.213
2.823	Call	Micron Technology	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	655.572	1.171.545
492	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 345	20/10/2023	(12.580)	265.680
414	Call	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 320	20/10/2023	(20.543)	335.340
24.620	Call	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	2.222.446	9.294.050
208	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 435	20/10/2023	(83.617)	64.376
2.588	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 463	20/10/2023	103.716	976.970
567	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	20/10/2023	(8.635)	8.505
2.479	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(211.267)	302.438
330	Call	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 530	20/10/2023	(350.371)	84.315
1.409	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/11/2023	37.047	602.347
106	Call	Broadcom	Exchange Traded	USD 900	17/11/2023	242.203	675.220
412	Call	Humana	Exchange Traded	USD 520	17/11/2023	(515.919)	206.000
8.478	Call	Kenvue	Exchange Traded	USD 25	17/11/2023	(167.313)	487.485
545	Call	Lennar	Exchange Traded	USD 135	17/11/2023	(271.788)	80.387
1.345	Call	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 140	17/11/2023	48.599	662.412
1.120	Put	Ford Motor	Exchange Traded	USD 10	15/12/2023	1.423	20.720
416	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 440	15/12/2023	1.796.193	3.565.120
569	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 14	15/12/2023	(8.097)	8.535
2.556	Call	Pfizer	Exchange Traded	USD 47	19/1/2024	(170.559)	24.282
4.258	Call	Pfizer	Exchange Traded	USD 50	19/1/2024	(169.872)	23.419
638	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 6	19/1/2024	22.187	35.728
563	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 7	19/1/2024	8.035	21.113
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 959.684.079)						(2.070.206)	57.564.543

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(145.392.721)	Put	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,079	25/9/2023	(244.900)	(716.520)
(120.773.063)	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16,2	12/9/2023	168.888	(5.025)
(40.290.000)	Call	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,11	20/10/2023	28.529	(81.795)
(1.992.995)	Call	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 262,243	10/11/2023	16.407	(45.668)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values)	Valeur de marché
						non réalisées USD	
(3.320.329)	Call	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 262,09	10/11/2023	27.259	(76.743)
(1.329.992)	Call	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 262,232	10/11/2023	(4)	(30.493)
(660)	Put	Albemarle	Exchange Traded	USD 180	15/9/2023	191.414	(36.300)
(1.239)	Call	Alibaba	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	204.349	(9.293)
(2.994)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(882.422)	(1.332.330)
(2.509)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(96.089)	(421.512)
(2.660)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	434.297	(51.870)
(1.938)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	234.851	(6.783)
(1.449)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	119.209	(44.195)
(1.044)	Call	Applied Materials	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	(248.982)	(493.290)
(454)	Call	CF Industries	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	66.781	(4.540)
(493)	Call	CrowdStrike	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	123.675	(40.919)
(493)	Put	CrowdStrike	Exchange Traded	USD 120	15/9/2023	68.151	(740)
(4.326)	Call	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	141.766	(4.326)
(245)	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(1.158.778)	(1.240.312)
(289)	Put	First Solar	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	(142.255)	(232.645)
(5.768)	Put	Ford Motor	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(379.126)	(510.468)
(1.730)	Put	General Motors	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	(145.940)	(295.830)
(165)	Call	Humana	Exchange Traded	USD 490	15/9/2023	59.535	(30.938)
(2.497)	Call	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 170	15/9/2023	90.711	(3.746)
(336)	Call	KLA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	179.404	(23.520)
(1.728)	Put	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	106.523	(18.144)
(729)	Put	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	8.751	(73.264)
(4.031)	Put	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 41	15/9/2023	122.021	(62.480)
(825)	Call	Micron Technology	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	85.652	(4.538)
(1.095)	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 380	15/9/2023	529.796	(6.023)
(669)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	15/9/2023	201.548	(21.074)
(671)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 320	15/9/2023	193.281	(146.278)
(178)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	125.892	(45.390)
(178)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 560	15/9/2023	171.055	(30.616)
(418)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 600	15/9/2023	324.442	(16.511)
(658)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 540	15/9/2023	458.467	(250.040)
(845)	Put	NVIDIA	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	1.067.097	(23.660)
(412)	Call	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 260	15/9/2023	62.816	(22.866)
(412)	Put	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	173.914	(2.060)
(5.572)	Put	Pfizer	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	119.961	(108.654)
(350)	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 250	15/9/2023	149.621	(7.350)
(2.182)	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	623.393	(27.275)
(264)	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 305	15/9/2023	133.222	(15.972)
(753)	Put	Tesla	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	234.385	(50.075)
(830)	Call	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	29.026	(12.450)
(499)	Put	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 70	15/9/2023	56.771	(4.491)
(2.773)	Put	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 42,5	15/9/2023	297.460	(37.436)
(1.058)	Put	UniCredit	Exchange Traded	EUR 20	15/9/2023	212.326	(22.670)
(637)	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	341.918	(172.627)
(729)	Put	Vinci	Exchange Traded	EUR 100	15/9/2023	64.232	(32.428)
(831)	Call	Walt Disney	Exchange Traded	USD 95	15/9/2023	115.871	(4.571)
(412)	Call	Zscaler	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	57.378	(102.382)
(412)	Put	Zscaler	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	96.930	(60.770)
(565)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 40	20/9/2023	9.475	(2.260)
(3.282)	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	(35.219)	(346.251)
(820)	Put	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 95	20/10/2023	147.540	(149.240)
(8.706)	Call	Alibaba	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	415.880	(174.120)
(2.468)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(116.568)	(624.404)
(2.468)	Put	Alphabet	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	227.720	(87.614)
(1.969)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 155	20/10/2023	(24.082)	(169.334)
(1.974)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	258.981	(87.843)
(2.430)	Put	Amazon.com	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	196.723	(184.680)
(1.641)	Call	Apple	Exchange Traded	USD 200	20/10/2023	(178.371)	(253.534)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(1.895)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	246.837	(82.432)
(829)	Call	Bunge	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	(83.948)	(145.075)
(2.468)	Call	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	79.641	(75.274)
(2.468)	Put	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	282.015	(159.186)
(823)	Call	Fortinet	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	33.553	(28.805)
(823)	Put	Fortinet	Exchange Traded	USD 45	20/10/2023	27.792	(8.230)
(2.496)	Call	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	226.448	(33.696)
(1.664)	Put	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 38	20/10/2023	(35.328)	(178.048)
(2.007)	Put	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 40	20/10/2023	(5.799)	(103.360)
(2.823)	Put	Micron Technology	Exchange Traded	USD 52,5	20/10/2023	193.101	(57.871)
(985)	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 370	20/10/2023	21.935	(124.602)
(246)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	20/10/2023	49.266	(56.457)
(414)	Call	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 350	20/10/2023	22.917	(49.680)
(414)	Put	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 270	20/10/2023	56.851	(48.645)
(24.620)	Call	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 190	20/10/2023	(239.566)	(1.711.090)
(2.479)	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 57,5	20/10/2023	87.433	(40.904)
(2.479)	Put	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 37,5	20/10/2023	55.206	(45.862)
(330)	Call	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 560	20/10/2023	128.293	(17.820)
(330)	Put	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 450	20/10/2023	(14.762)	(122.925)
(1.409)	Put	Amazon.com	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	96.348	(210.645)
(106)	Put	Broadcom	Exchange Traded	USD 760	17/11/2023	125.380	(98.580)
(412)	Call	Humana	Exchange Traded	USD 560	17/11/2023	194.779	(51.500)
(412)	Put	Humana	Exchange Traded	USD 440	17/11/2023	(77.141)	(327.540)
(8.478)	Put	Kenvue	Exchange Traded	USD 20	17/11/2023	40.403	(148.365)
(545)	Put	Lennar	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(97.597)	(242.525)
(931)	Call	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 82,5	17/11/2023	45.405	(9.310)
(931)	Put	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 65	17/11/2023	(23.955)	(137.322)
(1.345)	Put	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(40.964)	(175.522)
(416)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 530	15/12/2023	(884.933)	(1.649.440)
(416)	Put	NVIDIA	Exchange Traded	USD 310	15/12/2023	389.485	(71.344)
(461)	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/12/2023	(793.364)	(1.914.533)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 366.058.609)						6.028.289	(17.327.764)

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD 405.809.161	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 8/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 8/9/2024	Morgan Stanley	6/9/2023	(2.982.308)	635.136
USD 205.910.683	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,65% Fixed semi-annually from 14/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/9/2024	Citibank	12/9/2023	(1.347.871)	29.672
USD 61.700.555	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 15/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/9/2024	Citibank	13/9/2023	(473.316)	6.714
USD 13.320.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(30.063)	22.484
USD 12.290.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	BNP Paribas	20/9/2023	(38.492)	9.930
USD 13.305.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(64.411)	8.102
USD 8.860.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Barclays	20/9/2023	(25.611)	10.095

Global Allocation Fund suite

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD 56.250.298	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,81% Fixed semi-annually from 25/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 25/9/2024	Morgan Stanley	21/9/2023	(1.050.129)	65
USD 24.511.164	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,8% Fixed semi-annually from 26/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/9/2024	Morgan Stanley	22/9/2023	(607.829)	36
USD 113.325.463	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,75% Fixed annually from 23/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 23/10/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	(476.659)	20.085
USD 41.424.423	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/11/2024; and pays 3,65% Fixed semi-annually from 3/5/2024	Citibank	1/11/2023	223.130	768.474
USD 36.229.829	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 9/11/2024; and pays 4,82% Fixed semi-annually from 9/5/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(530.144)	27.102
USD 36.229.829	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,82% Fixed semi-annually from 9/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/11/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(396.697)	13.387
USD 28.169.866	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	(1.112.399)	49.225
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 343.272.013)				(8.912.799)	1.600.507

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (205.910.683)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 14/9/2024; and pays 3,3% Fixed semi-annually from 14/3/2024	Citibank	12/9/2023	547.317	(406)
USD (61.700.555)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 15/9/2024; and pays 3,1% Fixed semi-annually from 15/3/2024	Citibank	13/9/2023	117.217	(14)
USD (13.305.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	7.523	(2.788)
USD (8.860.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Barclays	20/9/2023	2.444	(2.429)
USD (96.857.671)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,93% Fixed semi-annually from 4/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 4/10/2024	Goldman Sachs	2/10/2023	37.924	(669.137)
USD (135.424.226)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,5% Fixed semi-annually from 17/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 17/10/2024	Goldman Sachs	13/10/2023	(2.564.638)	(3.966.279)
USD (302.911.482)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,05% Fixed semi-annually from 18/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/10/2024	Goldman Sachs	16/10/2023	(2.983.327)	(3.839.052)
USD (272.119.467)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,25% Fixed semi-annually from 19/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 19/10/2024	Citibank	17/10/2023	(1.677.173)	(2.534.349)
USD (56.662.731)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,3% Fixed annually from 23/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 23/10/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	(94.925)	(295.133)
USD (113.325.463)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 23/10/2024; and pays 2,45% Fixed annually from 23/4/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	306.057	(5.588)
USD (209.364.224)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,4% Fixed semi-annually from 30/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 31/10/2024	Goldman Sachs	27/10/2023	401.050	(520.153)
USD (207.122.114)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Citibank	1/11/2023	151.893	(262.351)
USD (41.424.423)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Goldman Sachs	1/11/2023	322.737	(228.208)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (112.679.426)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	38.203	(345.693)
USD (281.698.657)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 16/11/2024; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 16/5/2024	Citibank	14/11/2023	967.759	(16.212)
USD (49.188.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 18/12/2024; and pays 2,4% Fixed semi-annually from 18/6/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	881.065	(14.156)
USD (49.188.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 18/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/12/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	(377.517)	(1.336.682)
USD (103.523.246)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,5% Fixed semi-annually from 9/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/1/2025	Citibank	5/1/2024	231.417	(414.568)
USD (281.591.969)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,79% Fixed semi-annually from 1/10/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 1/4/2025	JP Morgan	27/3/2024	(1.847.122)	(4.750.335)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 987.956.843)				(5.532.096)	(19.203.533)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Australie			
(91.299)	Brambles	JP Morgan	(41.619)
(446.350)	Computershare	JP Morgan	(6.802)
(229.434)	Evolution Mining	JP Morgan	3.058
(30.204)	Fortescue Metals	JP Morgan	(187)
(46.896)	IDP Education	JP Morgan	(8.241)
(83.227)	IGO	JP Morgan	(24.478)
(136.330)	Lendlease	JP Morgan	48.230
(11.078)	Macquarie	JP Morgan	186
(57.949)	Mineral Resources	JP Morgan	(59.132)
(144.282)	Pilbara Minerals	JP Morgan	67.396
(91.341)	Santos	JP Morgan	17.424
(116.788)	Suncorp	JP Morgan	22.895
(14.684)	Woodside Energy	JP Morgan	17.985
			36.715
Belgique			
(4.320)	D'ieteren	Citibank	3.815
(7.004)	D'ieteren	JP Morgan	67.801
			71.616
Bermudes			
(6.891)	Arch Capital	Citibank	(15.780)
			(15.780)
Brésil			
(298.858)	Alpargatas	JP Morgan	28.433
(89.414)	Banco BTG Pactual	JP Morgan	14.709
(365.537)	BRF	JP Morgan	53.352
(177.796)	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	Citibank	44.306
(7.288.912)	Hapvida Participacoes e Investimentos	JP Morgan	895.160
(281.069)	Localiza Rent a Car	JP Morgan	207.733
(49.517)	Suzano	Citibank	(10.852)
			1.232.841

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Canada			
(17.699)	Brookfield Asset Management	Citibank	(35.900)
(20.141)	Cenovus Energy	JP Morgan	(7.834)
(25.893)	Great-West Lifeco	JP Morgan	32.350
(25.701)	Intact Financial	JP Morgan	115.450
(10.495)	Intact Financial	Citibank	(7.853)
(79.815)	Power of Canada	JP Morgan	51.852
(90.213)	Power of Canada	Citibank	(98.426)
(27.399)	Restaurant Brands International	Citibank	(25.370)
(19.471)	Restaurant Brands International	JP Morgan	77.634
			101.903
Îles Caïmans			
(170.800)	Sands China	JP Morgan	60.681
			60.681
Chine			
(2.100.000)	China Southern Airlines	JP Morgan	115.615
(407.279)	China Vanke	Citibank	3.613
(490.000)	Flat Glass	JP Morgan	134.070
(82.800)	Fuyao Glass Industry	JP Morgan	(5.103)
(6.000)	Fuyao Glass Industry	Citibank	220
(438.500)	Li Ning	JP Morgan	307.575
(100.000)	Li Ning	Citibank	3.044
(1.540.000)	PICC Property & Casualty	JP Morgan	(34.935)
(755.250)	Shandong Gold Mining	JP Morgan	(31.400)
(3.756.200)	Xiaomi	JP Morgan	(117.495)
(1.060.000)	Xiaomi	Citibank	(117.297)
(684.500)	XPeng	Citibank	(731.427)
(115.400)	XPeng	JP Morgan	(41.810)
(191.100)	Zhuzhou CRRRC Times Electric	JP Morgan	27.597
(204.200)	Zhuzhou CRRRC Times Electric	Citibank	(50.073)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(131.800)	ZTE	Citibank	2.963
			(534.843)
Danemark			
(24.976)	Tryg	Citibank	(14.555)
			(14.555)
Finlande			
(102.710)	Metso	JP Morgan	(60.675)
(75.467)	Metso	Citibank	(37.177)
(86.377)	Nordea Bank	Citibank	(12.919)
			(110.771)
France			
(23.709)	Pernod Ricard	JP Morgan	353.762
(19.305)	Sartorius Stedim Biotech	JP Morgan	5.069
			358.831
Allemagne			
(35.363)	Delivery Hero	JP Morgan	142.653
(79.270)	HelloFresh	JP Morgan	(374.352)
(15.143)	HelloFresh	Citibank	(48.581)
(9.161)	HOCHTIEF	JP Morgan	(89.008)
(2.436)	Sartorius	Citibank	(71.539)
(12.313)	Sartorius	JP Morgan	(356.904)
(15.632)	Talanx	JP Morgan	(79.587)
(220.684)	Vonovia	Citibank	(588.567)
			(1.465.885)
Hong Kong			
(469.500)	China Overseas Land & Investment	Citibank	(66.168)
(1.513.000)	Sino Biopharmaceutical	JP Morgan	26.001
			(40.167)
Irlande			
(19.125)	James Hardie Industries	JP Morgan	8.783
			8.783
Italie			
(111.338)	Nexi	Citibank	(24.087)
(1.618.527)	Telecom Italia	JP Morgan	(52.900)
(11.238.558)	Telecom Italia	Citibank	(128.059)
			(205.046)
Japon			
(3.100)	Advantest	Citibank	22.069
(25.200)	Advantest	JP Morgan	788
(372.400)	ENEOS	Citibank	(60.750)
(24.300)	Fujitsu General	JP Morgan	35.373
(17.200)	Hitachi	Citibank	(38.351)
(8.900)	Lasertec	Citibank	(40.501)
(71.500)	MatsukiyoCocokara	Citibank	120.796
(131.900)	Mercari	JP Morgan	143.312
(24.200)	Mercari	Citibank	(35.669)
(37.100)	Mitsubishi Estate	Citibank	(27.164)
(32.100)	Mitsui Fudosan	JP Morgan	(23.576)
(12.500)	NEC	Citibank	(18.579)
(174.400)	Olympus	JP Morgan	470.248
(71.700)	Olympus	Citibank	(82.948)
(5.900)	Open House	Citibank	(7.095)
(43.500)	Park24	JP Morgan	3.390
(1.390.200)	Rakuten	JP Morgan	40.923
(87.800)	Recruit	Citibank	(207.227)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(10.900)	RENOVA	Citibank	(1.696)
(69.000)	RENOVA	JP Morgan	35.240
(62.100)	SBI	JP Morgan	37.825
(14.400)	Socionext	JP Morgan	(100.875)
(22.500)	SoftBank	JP Morgan	66.971
(17.200)	SoftBank	Citibank	14.314
(10.600)	Sony	Citibank	(4.970)
(42.400)	Square Enix	JP Morgan	48.311
(171.300)	SUMCO	Citibank	9.039
(51.700)	SUMCO	JP Morgan	23.339
(21.300)	Sumitomo	JP Morgan	4.231
(11.100)	TDK	Citibank	(21.317)
			405.451
Luxembourg			
(207.764)	InPost	JP Morgan	(75.859)
(27.818)	Reinet Investments	JP Morgan	25.833
			(50.026)
Malaisie			
(478.405)	Lynas Rare Earths	JP Morgan	(51.685)
			(51.685)
Mexique			
(5.809.371)	America Movil	Citibank	(118.662)
			(118.662)
Pays-Bas			
(15.470)	Heineken	Citibank	(15.377)
(34.447)	Koninklijke Philips	JP Morgan	(79.071)
(126.191)	Koninklijke Philips	Citibank	(28.369)
			(122.817)
Norvège			
(3.245)	Aker	Citibank	(940)
(74.445)	Aker BP	Citibank	(17.317)
(13.485)	Nordic Semiconductor	JP Morgan	19.281
(32.981)	Nordic Semiconductor	Citibank	3.044
(26.598)	Salmar	Citibank	(112.252)
			(108.184)
Pologne			
(24.945)	Bank Polska Kasa Opieki	JP Morgan	34.386
(39.578)	KGHM Polska Miedz	Citibank	(44.200)
(203)	LPP	Citibank	(58.361)
(45.166)	ORLEN	JP Morgan	80.474
			12.299
Singapour			
(112.145)	Sea	JP Morgan	1.622.294
			1.622.294
Afrique du Sud			
(45.055)	Sasol	JP Morgan	2.026
			2.026
Corée du Sud			
(67.436)	Kakao	Citibank	2.506
(26.096)	Kakao	JP Morgan	76.966
(1.101)	LG Chem	Citibank	(13.244)
(7.016)	LG Electronics	JP Morgan	22.782
(17.159)	Lotte Energy Materials	JP Morgan	31.091
(757)	LS	JP Morgan	(161)
(3.407)	POSCO	JP Morgan	(34.783)
(15.943)	POSCO Future M	JP Morgan	(12.096)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Allocation Fund suite

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(7.268)	SK	JP Morgan	46.228
(8.668)	SK Innovation	JP Morgan	82.179
(499)	SK Innovation	JP Morgan	(2.011)
			199.457
Suède			
(51.148)	Electrolux	Citibank	20.991
(46.105)	EQT	Citibank	14.270
(30.449)	Essity	Citibank	(18.851)
(328.437)	Fastighets Balder	Citibank	(153.142)
(30.436)	Sagax	Citibank	(35.726)
(66.844)	Securitas	JP Morgan	(791)
			(173.249)
Suisse			
(37.620)	Bachem	JP Morgan	145.497
(3.759)	Cie Financiere Richemont	JP Morgan	24.885
(207.377)	SIG	Citibank	(371.694)
(9.925)	Straumann	Citibank	(16.103)
(7.583)	Tecan	JP Morgan	(142.558)
(142.889)	UBS	JP Morgan	(695.591)
			(1.055.564)
Taiwan			
(72.000)	Powerchip Semiconductor Manufacturing	JP Morgan	1.612
			1.612
Royaume-Uni			
(596.643)	Centrica	JP Morgan	(88.591)
(360.658)	Ocado	JP Morgan	(26.593)
(157.501)	Rentokil Initial	Citibank	(45.611)
			(160.795)
États-Unis			
(11.026)	Aflac	Citibank	(20.839)
(20.669)	Air Transport Services	JP Morgan	21.082
(3.951)	Airbnb	JP Morgan	31.687
(1.114)	Align Technology	JP Morgan	(17.378)
(1.950)	Arista Networks	Citibank	(20.642)
(4.392)	Avery Dennison	JP Morgan	(28.601)
46.887	Banc of California	JP Morgan	35.301
(28.094)	Bank of America	JP Morgan	65.880
(21.750)	Bank of Hawaii	JP Morgan	33.930
(22.352)	BankUnited	JP Morgan	81.808
(16.262)	Banner	JP Morgan	65.698
(41.626)	Blackstone	Citibank	(311.427)
(9.276)	Block	JP Morgan	29.773
(104.819)	Boston Properties	JP Morgan	85.190
(3.983)	Brandywine Realty Trust	JP Morgan	(518)
(20.935)	Broadridge Financial Solutions	JP Morgan	(202.416)
(5.516)	Broadridge Financial Solutions	Citibank	(53.505)
(4.507)	Capital One Financial	JP Morgan	51.019
(27.820)	Celanese	Citibank	(235.620)
(6.579)	Celanese	JP Morgan	(9.327)
(28.326)	Charles River Laboratories International	JP Morgan	(121.634)
(5.975)	Charles River Laboratories International	Citibank	(59.631)
(31.216)	Charles Schwab	JP Morgan	181.365

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(15.208)	Church & Dwight	Citibank	(52.163)
(27.516)	Church & Dwight	JP Morgan	(17.610)
(152.616)	Cloudflare	JP Morgan	158.721
(32.774)	Community Bank System	JP Morgan	215.653
(84.268)	Constellation Energy	Citibank	64.284
(5.482)	CoStar	JP Morgan	(1.590)
(9.685)	Crown Castle	JP Morgan	3.297
(4.652)	Darden Restaurants	JP Morgan	35.960
(5.261)	Discover Financial Services	Citibank	(8.944)
(15.159)	DXC Technology	JP Morgan	(1.946)
(2.671)	Enphase Energy	JP Morgan	15.170
(6.621)	EPAM Systems	JP Morgan	(94.873)
(7.805)	Equifax	Citibank	(130.344)
(5.802)	Equifax	JP Morgan	(54.771)
(28.956)	FB Financial	JP Morgan	110.033
(8.893)	Fiserv	JP Morgan	22.686
(3.627)	Ford Motor	Citibank	(1.016)
(24.993)	Frontier Communications Parent	JP Morgan	55.235
(83.006)	Gen Digital	Citibank	(8.076)
(3.638)	Generac	JP Morgan	(31.746)
(26.350)	Glacier Bancorp	JP Morgan	86.428
(34.972)	Hasbro	Citibank	(116.312)
(154.632)	Huntington Bancshares	JP Morgan	139.169
(25.762)	Illumina	Citibank	(124.189)
(22.013)	Independent Bank	JP Morgan	38.633
(11.275)	International Business Machines	JP Morgan	(24.520)
(13.086)	Iron Mountain	Citibank	(52.606)
(31.736)	Iron Mountain	JP Morgan	(88.543)
(31.343)	J M Smucker	JP Morgan	95.596
(26.885)	Kimco Realty	Citibank	(10.754)
(26.840)	KKR	JP Morgan	(33.803)
(44.269)	KKR	Citibank	(136.229)
(40.494)	Lamb Weston	Citibank	(73.777)
(15.078)	Lamb Weston	JP Morgan	35.132
(1.132)	Martin Marietta Materials	JP Morgan	12.860
57	MercadoLibre	Citibank	6.228
(57)	MercadoLibre	JP Morgan	(1.347)
(10.325)	Mosaic	Citibank	(2.403)
(223.272)	Newell Brands	Citibank	(68.098)
(53.280)	Newell Brands	JP Morgan	7.726
(12.799)	Occidental Petroleum	Citibank	2.816
(27.909)	OceanFirst Financial	JP Morgan	35.724
(136)	Old Dominion Freight Line	Citibank	(2.877)
(3.475)	Old Dominion Freight Line	JP Morgan	(59.266)
(6.022)	ON Semiconductor	JP Morgan	7.461
(19.157)	Oracle	Citibank	(83.525)
(7.621)	Oracle	JP Morgan	(41.484)
(41.404)	Pacific Premier Bancorp	JP Morgan	116.345
(71.376)	PacWest Bancorp	JP Morgan	(46.644)
(434.028)	Palantir Technologies	JP Morgan	865.886
(406.018)	Paramount Global	Citibank	(266.526)
(7.637)	PayPal	JP Morgan	(13.478)
(4.146)	Pool	JP Morgan	29.214
(12.334)	Prosperity Bancshares	JP Morgan	49.089
(6.465)	QUALCOMM	JP Morgan	22.687

Global Allocation Fund suite

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(18.519)	Quanta Services	Citibank	(95.743)
(6.277)	Ralph Lauren	JP Morgan	89.755
(7.514)	Raymond James Financial	Citibank	(18.484)
(24.045)	Raymond James Financial	JP Morgan	82.234
(11.636)	Realty Income	JP Morgan	3.057
(22.872)	Republic Services	Citibank	14.638
(3.168)	Republic Services	JP Morgan	4.784
(28.174)	Revvity	JP Morgan	32.930
(5.684)	Revvity	Citibank	(30.921)
(15.130)	Sabre	JP Morgan	4.085
(45.598)	Simmons First National	JP Morgan	74.781
(6.483)	Simon Property	JP Morgan	36.436
(32.332)	Snowflake	JP Morgan	(33.302)
(210.835)	Southwest Airlines	Citibank	(19.258)
(20.076)	STERIS	JP Morgan	(134.500)
(62.931)	Take-Two Interactive Software	Citibank	(126.794)
(11.174)	Targa Resources	JP Morgan	(37.768)
(6.916)	Teledyne Technologies	Citibank	(99.106)
(53.288)	Truist Financial	JP Morgan	98.316

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(15.292)	Tyson Foods	JP Morgan	19.934
(180.045)	Valley National Bancorp	JP Morgan	150.214
(29.031)	Washington Federal	JP Morgan	90.286
(30.509)	Western Alliance Bancorp	JP Morgan	61.323
(14.689)	Xerox	JP Morgan	(4.847)
(10.031)	Zions Bancorp	JP Morgan	28.789
			374.607
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 414.987.986)			261.087

Engagements SPAC PIPE au 31 août 2023

Nombre	Description	Montant engagement USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
États-Unis			
5.447.000	FLYR	5.447.000	–
Total		5.447.000	–

Global Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 2.000.000	Volkswagen Financial Services 3% 6/4/2025*	2.139.273	0,25	EUR 4.520.000	BP Capital Markets 4,323% 12/5/2035	4.862.367	0,55
EUR 700.000	Vonovia 0,625% 14/12/2029	581.638	0,07	EUR 900.000	de Volksbank 2,375% 4/5/2027	920.793	0,10
EUR 300.000	Vonovia 1,5% 14/6/2041	180.032	0,02	EUR 949.000	Digital Dutch Finco 1% 15/1/2032	745.064	0,09
		36.997.277	4,21	GBP 2.000.000	E.ON International Finance 6,375% 7/6/2032	2.632.439	0,30
	International			GBP 1.147.000	Enel Finance International 2,875% 11/4/2029	1.241.558	0,14
EUR 2.528.000	European Union 2,625% 4/2/2048	2.425.866	0,28	GBP 2.000.000	Enel Finance International 5,625% 14/8/2024	2.529.018	0,29
EUR 2.290.000	European Union 3% 4/3/2053	2.292.515	0,26	USD 200.000	Enel Finance International 7,75% 14/10/2052	229.347	0,03
		4.718.381	0,54	EUR 2.900.000	IMCD 2,125% 31/3/2027	2.866.002	0,33
	Irlande			EUR 1.670.000	Imperial Brands Finance Netherlands 5,25% 15/2/2031	1.799.583	0,20
USD 1.200.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 3,3% 30/1/2032	974.834	0,11	EUR 1.900.000	ING Groep 1% 16/11/2032	1.731.069	0,20
EUR 2.500.000	CRH SMW Finance 4% 11/7/2031	2.693.726	0,31	EUR 600.000	ING Groep 4,75% 23/5/2034	650.154	0,07
EUR 1.038.000	GE Capital European Funding Unlimited 3,65% 23/8/2032	1.080.186	0,12	EUR 1.200.000	ING Groep 5% 20/2/2035	1.270.259	0,14
EUR 465.000	Glencore Capital Finance 1,125% 10/3/2028	434.345	0,05	GBP 600.000	ING Groep 6,25% 20/5/2033*	718.567	0,08
EUR 1.400.000	Linde 3,625% 12/6/2034*	1.498.174	0,17	USD 475.000	JDE Peet's 1,375% 15/1/2027	412.347	0,05
		6.681.265	0,76	EUR 1.250.000	NN 6% 3/11/2043	1.360.589	0,16
	Italie			USD 855.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,15% 1/5/2027	790.157	0,09
EUR 1.650.000	A2A 4,5% 19/9/2030	1.811.123	0,21	USD 1.100.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,25% 30/11/2051	711.799	0,08
EUR 1.044.000	ASTM 2,375% 25/11/2033*	884.036	0,10	EUR 1.521.000	Repsol International Finance 4,5% 25/3/2075*	1.622.973	0,18
EUR 3.050.000	Eni 4,25% 19/5/2033	3.289.890	0,37	EUR 2.100.000	Syngenta Finance 3,375% 16/4/2026	2.211.322	0,25
EUR 2.300.000	Intesa Sanpaolo 5,125% 29/8/2031	2.532.318	0,29	EUR 4.000.000	Telefonica Europe 3% 2/10/2023	4.328.063	0,49
USD 900.000	Intesa Sanpaolo 7,778% 20/6/2054	886.749	0,10	EUR 2.600.000	TenneT 2,374% 22/7/2025	2.673.468	0,30
USD 1.000.000	Intesa Sanpaolo 8,248% 21/11/2033	1.046.207	0,12	EUR 1.200.000	TenneT 2,75% 17/5/2042	1.133.769	0,13
EUR 12.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0% 12/1/2024	12.848.186	1,46	EUR 1.320.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3,75% 9/5/2027	1.312.739	0,15
EUR 20.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0% 14/5/2024	21.140.154	2,41	EUR 167.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4,5% 1/3/2025	179.130	0,02
USD 2.325.000	UniCredit 1,982% 3/6/2027	2.065.061	0,23	EUR 2.540.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,375% 15/9/2029	2.828.858	0,32
		46.503.724	5,29	EUR 2.520.000	Universal Music 4% 13/6/2031	2.720.323	0,31
	Japon			EUR 3.259.000	Viterra Finance 1% 24/9/2028	2.994.942	0,34
USD 4.300.000	Nissan Motor 4,345% 17/9/2027*	3.934.005	0,45	GBP 1.400.000	Volkswagen Financial Services 1,625% 10/2/2024	1.744.327	0,20
	Jersey			EUR 2.400.000	Volkswagen International Finance 3,375% 27/6/2024	2.542.678	0,29
GBP 4.805.000	Glencore Finance Europe 3,125% 26/3/2026	5.685.969	0,65	EUR 4.400.000	Volkswagen International Finance 3,5% 17/6/2025	4.509.054	0,51
	Luxembourg			EUR 3.100.000	Volkswagen International Finance 3,875% 17/6/2029	2.813.277	0,32
USD 2.500.000	Greensaif Pipelines Bidco 6,129% 23/2/2038*	2.512.750	0,28	EUR 2.700.000	Wintershall Dea Finance 1,332% 25/9/2028	2.494.651	0,28
USD 1.530.000	Greensaif Pipelines Bidco 6,51% 23/2/2042	1.547.909	0,18	EUR 2.100.000	Wintershall Dea Finance 1,823% 25/9/2031	1.810.605	0,21
USD 2.095.000	Medtronic Global 4,5% 30/3/2033	2.027.442	0,23	EUR 4.700.000	Wintershall Dea Finance 2 2,499% 20/4/2026	4.446.540	0,51
EUR 822.000	Prologis International Funding II 0,75% 23/3/2033	620.331	0,07	EUR 300.000	Wintershall Dea Finance 2 3% 20/7/2028	262.177	0,03
EUR 788.000	Prologis International Funding II 1,625% 17/6/2032	665.105	0,08			75.596.242	8,60
EUR 6.414.000	SES 2,875% 27/5/2026	6.069.151	0,69		Norvège		
		13.442.688	1,53	EUR 1.910.000	Var Energi 5,5% 4/5/2029	2.094.519	0,24
	Pays-Bas				Pologne		
EUR 400.000	ABN AMRO Bank 5,125% 22/2/2033*	426.818	0,05	EUR 720.000	Republic of Poland Government International Bond 4,25% 14/2/2043	763.596	0,08
EUR 5.800.000	ABN AMRO Bank 5,5% 21/9/2033	6.270.412	0,72		Portugal		
EUR 700.000	ASR Nederland 7% 7/12/2043	799.004	0,09	EUR 1.200.000	EDP - Energias de Portugal 1,7% 20/7/2080	1.203.313	0,14

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Arabie Saoudite				USD 1.450.000	HSBC 8,113% 3/11/2033	1.577.496	0,18
USD 700.000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053	623.262	0,07	GBP 300.000	Imperial Brands Finance 4,875% 7/6/2032	327.506	0,04
Singapour				GBP 2.500.000	Imperial Brands Finance 5,5% 28/9/2026	3.092.828	0,35
USD 5.500.000	Pfizer Investment Enterprises 5,11% 19/5/2043	5.368.537	0,61	GBP 1.500.000	Imperial Brands Finance 8,125% 15/3/2024	1.918.978	0,22
USD 2.220.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	2.224.602	0,25	EUR 780.000	Lloyds Bank Corporate Markets 4,125% 30/5/2027	844.087	0,10
		7.593.139	0,86	GBP 1.100.000	Lloyds Banking 1,875% 15/1/2026	1.312.430	0,15
Corée du Sud				USD 660.000	Lloyds Banking 4,65% 24/3/2026	637.031	0,07
USD 850.000	SK Broadband 4,875% 28/6/2028*	838.431	0,10	GBP 2.100.000	Mobico 2,375% 20/11/2028	2.214.514	0,25
Espagne				EUR 1.080.000	National Grid 4,275% 16/1/2035*	1.143.302	0,13
GBP 2.300.000	Banco Santander 1,5% 14/4/2026	2.572.694	0,29	USD 5.310.000	National Grid 5,602% 12/6/2028	5.316.985	0,61
EUR 2.800.000	Banco Santander 5,75% 23/8/2033	3.030.253	0,35	GBP 2.100.000	National Grid Electricity Distribution West Midlands 5,75% 16/4/2032	2.627.921	0,30
USD 1.600.000	Banco Santander 6,921% 8/8/2033	1.603.062	0,18	GBP 2.270.000	Nationwide Building Society 6,125% 21/8/2028	2.885.090	0,33
GBP 2.600.000	Telefonica Emisiones 5,445% 8/10/2029	3.207.455	0,36	USD 5.200.000	NatWest 3,754% 1/11/2029	4.961.837	0,56
USD 1.700.000	Telefonica Emisiones 7,045% 20/6/2036	1.810.639	0,21	EUR 1.000.000	NatWest 5,763% 28/2/2034	1.081.201	0,12
		12.224.103	1,39	USD 2.000.000	NatWest 5,808% 13/9/2029	1.981.213	0,23
Suisse				USD 3.000.000	NatWest 7,472% 10/11/2026	3.087.148	0,35
EUR 3.500.000	Credit Suisse 0,25% 5/1/2026	3.457.666	0,39	EUR 1.310.000	NGG Finance 1,625% 5/12/2079	1.355.344	0,15
EUR 1.549.000	Credit Suisse 0,25% 1/9/2028	1.387.756	0,16	GBP 2.200.000	Rio Tinto Finance 4% 11/12/2029	2.565.953	0,29
USD 625.000	Credit Suisse 5% 9/7/2027	607.274	0,07	USD 955.000	Rio Tinto Finance USA 5% 9/3/2033	949.330	0,11
EUR 4.300.000	Credit Suisse 5,5% 20/8/2026	4.821.383	0,55	USD 800.000	Rio Tinto Finance USA 5,125% 9/3/2053	776.166	0,09
USD 4.550.000	Credit Suisse 7,5% 15/2/2028	4.855.321	0,55	USD 1.759.000	Santander UK 5% 7/11/2023	1.752.646	0,20
GBP 867.000	Credit Suisse 7,75% 10/3/2026	1.135.788	0,13	USD 1.700.000	Santander UK 6,833% 21/11/2026	1.719.886	0,20
EUR 3.000.000	UBS 1% 24/6/2027	2.948.741	0,34	GBP 1.100.000	Sky 6% 21/5/2027	1.414.493	0,16
GBP 300.000	UBS 2,25% 9/6/2028	327.418	0,04	EUR 218.000	Standard Chartered 0,9% 2/7/2027	214.152	0,02
EUR 2.000.000	UBS 3,25% 2/4/2026	2.129.010	0,24	USD 700.000	Standard Chartered 5,7% 26/3/2044	634.914	0,07
USD 6.100.000	UBS 5,125% 15/5/2024	6.019.815	0,68	GBP 2.081.000	Thames Water Utilities Finance 4% 19/6/2025	2.467.949	0,28
USD 700.000	UBS 6,537% 12/8/2033	728.719	0,08	GBP 15.570.020	United Kingdom Gilt 1,5% 31/7/2053	9.916.038	1,13
GBP 800.000	UBS 7% 30/9/2027	1.026.802	0,12			101.284.066	11,53
EUR 3.800.000	UBS 7,75% 1/3/2029	4.661.723	0,53	États-Unis			
USD 5.388.000	UBS 9,016% 15/11/2033	6.533.910	0,74	USD 590.000	7-Eleven 1,8% 10/2/2031	462.982	0,05
		40.641.326	4,62	USD 2.500.000	AbbVie 4,3% 14/5/2036	2.288.347	0,26
Royaume-Uni				USD 2.200.000	AbbVie 4,5% 14/5/2035	2.069.456	0,24
EUR 3.740.000	Anglo American Capital 4,5% 15/9/2028	4.071.674	0,46	USD 1.120.000	AEP Texas 5,4% 1/6/2033	1.107.764	0,13
USD 400.000	Aon Global 4,45% 24/5/2043	314.597	0,04	USD 630.000	AEP Transmission 3,65% 1/4/2050	476.606	0,05
EUR 5.800.000	Babcock International 1,375% 13/9/2027	5.613.153	0,64	USD 400.000	Aetna 4,125% 15/11/2042	318.999	0,04
GBP 4.679.000	Babcock International 1,875% 5/10/2026	5.203.839	0,59	USD 2.500.000	Alexandria Real Estate Equities 2,95% 15/3/2034	1.979.621	0,22
USD 1.900.000	Barclays 3,564% 23/9/2035	1.510.517	0,17	USD 380.000	Alexandria Real Estate Equities 3% 18/5/2051	230.183	0,03
EUR 1.560.000	Barclays 4,918% 8/8/2030	1.695.671	0,19	USD 2.500.000	Amazon.com 4,7% 1/12/2032	2.485.974	0,28
EUR 2.300.000	Barclays 5,262% 29/1/2034	2.494.838	0,28	EUR 659.000	American Tower 0,5% 15/1/2028	609.162	0,07
USD 3.200.000	Barclays 7,437% 2/11/2033	3.419.210	0,38	EUR 2.800.000	American Tower 0,875% 21/5/2029	2.494.816	0,28
EUR 1.309.000	BAT International Finance 2,25% 16/1/2030	1.213.264	0,14	USD 1.460.000	American Tower 2,7% 15/4/2031	1.194.419	0,14
EUR 2.000.000	British Telecommunications 1,874% 18/8/2080	1.985.016	0,23	USD 709.000	American Tower 3,65% 15/3/2027	664.910	0,08
GBP 1.109.000	British Telecommunications 3,125% 21/11/2031	1.156.896	0,13	USD 200.000	American Tower 5,65% 15/3/2033	199.236	0,02
EUR 1.200.000	Chanel Ceres 0,5% 31/7/2026	1.171.500	0,13	USD 500.000	American Water Capital 3,45% 1/5/2050	364.055	0,04
EUR 894.000	Channel Link Enterprises Finance 2,706% 30/6/2050	886.676	0,10	USD 1.140.000	Amgen 3,375% 21/2/2050	812.676	0,09
GBP 1.234.000	Channel Link Enterprises Finance 3,043% 30/6/2050	1.306.768	0,15	USD 1.055.000	Amgen 4,2% 22/2/2052	842.146	0,09
EUR 4.100.000	DS Smith 4,5% 27/7/2030	4.420.963	0,51	USD 3.000.000	Amgen 5,25% 2/3/2033	2.985.589	0,34
GBP 2.390.000	HSBC 2,256% 13/11/2026	2.770.391	0,32	USD 2.165.000	Amgen 5,65% 2/3/2053	2.152.426	0,25
EUR 1.650.000	HSBC 4,856% 23/5/2033	1.802.556	0,21				
USD 1.400.000	HSBC 7,39% 3/11/2028	1.470.099	0,17				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.729.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 5,55% 23/1/2049	1.774.307	0,20	USD 3.510.000	CNH Industrial Capital 4,55% 10/4/2028	3.393.069	0,39
USD 2.000.000	Astrazeneca Finance 2,25% 28/5/2031	1.664.369	0,19	USD 1.775.000	Columbia Pipelines Operating 6,544% 15/11/2053	1.819.923	0,21
USD 5.400.000	AT&T 2,55% 1/12/2033	4.122.350	0,47	USD 1.754.000	Comcast 2,887% 1/11/2051	1.126.263	0,13
EUR 3.600.000	AT&T 2,875% 2/3/2025	3.635.912	0,41	USD 2.000.000	Comcast 2,937% 1/11/2056	1.246.562	0,14
USD 1.550.000	AT&T 4,5% 15/5/2035	1.377.114	0,16	USD 1.000.000	Comcast 3,25% 1/11/2039	771.061	0,09
USD 190.000	AT&T 4,5% 9/3/2048	151.661	0,02	USD 500.000	Comcast 4,25% 15/10/2030	475.627	0,05
GBP 3.300.000	AT&T 5,5% 15/3/2027	4.078.688	0,46	USD 250.000	CommonSpirit Health 3,91% 1/10/2050	189.219	0,02
USD 1.500.000	Atmos Energy 2,85% 15/2/2052	972.565	0,11	USD 1.000.000	Connecticut Light and Power 2,05% 1/7/2031	806.646	0,09
USD 1.000.000	Baltimore Gas and Electric 3,5% 15/8/2046	724.962	0,08	USD 480.000	Consumers Energy 3,1% 15/8/2050	330.663	0,04
USD 235.000	Baltimore Gas and Electric 5,4% 1/6/2053	232.085	0,03	USD 430.000	Consumers Energy 4,2% 1/9/2052	354.915	0,04
USD 1.200.000	Bank of America 2,482% 21/9/2036*	914.718	0,10	USD 3.200.000	Consumers Energy 4,625% 15/5/2033	3.103.165	0,35
USD 1.150.000	Bank of America 2,687% 22/4/2032	941.320	0,11	USD 2.925.000	Consumers Energy 4,9% 15/2/2029	2.899.991	0,33
USD 2.450.000	Bank of America 3,419% 20/12/2028	2.244.837	0,26	USD 280.000	Coterra Energy 4,375% 15/3/2029	263.226	0,03
USD 5.206.000	Bank of America 4,271% 23/7/2029	4.912.054	0,56	USD 700.000	Cox Communications 2,6% 15/6/2031	565.724	0,06
USD 5.350.000	Bank of America 4,571% 27/4/2033	4.961.587	0,56	USD 1.639.000	Crown Castle 2,9% 15/3/2027	1.503.579	0,17
USD 1.900.000	Bank of America 5,015% 22/7/2033	1.826.589	0,21	USD 120.000	Crown Castle 4,15% 1/7/2050	90.776	0,01
USD 2.750.000	Bank of America 5,202% 25/4/2029	2.708.517	0,31	USD 2.145.000	Crown Castle 5% 11/1/2028	2.104.996	0,24
USD 1.290.000	Barrick North America Finance 5,7% 30/5/2041	1.283.031	0,15	USD 70.000	CSX 4,5% 15/11/2052	61.080	0,01
USD 300.000	Bayer US Finance II 4,7% 15/7/2064	229.430	0,03	USD 1.050.000	CVS Health 5,125% 20/7/2045	935.534	0,11
USD 400.000	Boeing 3,55% 1/3/2038	307.420	0,03	USD 731.000	DCP Midstream Operating 3,25% 15/2/2032	610.086	0,07
USD 900.000	Boeing 3,65% 1/3/2047	631.852	0,07	USD 911.000	Devon Energy 4,75% 15/5/2042	759.906	0,09
USD 3.900.000	Boeing 5,15% 1/5/2030*	3.835.190	0,44	USD 325.000	Diamondback Energy 4,25% 15/3/2052	244.342	0,03
USD 1.350.000	Boeing 5,93% 1/5/2060	1.307.179	0,14	GBP 700.000	Digital Stout 2,75% 19/7/2024	860.841	0,10
USD 1.080.000	Bristol-Myers Squibb 4,25% 26/10/2049	913.659	0,10	USD 1.615.000	Dominion Energy 2,25% 15/8/2031	1.287.722	0,15
USD 2.279.000	Broadcom 4,926% 15/5/2037	2.050.318	0,23	USD 2.600.000	Dominion Energy 3,375% 1/4/2030	2.295.673	0,26
USD 800.000	Cameron LNG 3,302% 15/1/2035	663.146	0,07	USD 2.565.000	Duke Energy 3,25% 15/1/2082	1.902.052	0,22
USD 525.000	Cameron LNG 3,701% 15/1/2039	422.211	0,05	USD 900.000	Duke Energy Carolinas 3,2% 15/8/2049	619.184	0,07
EUR 1.000.000	Capital One Financial 1,65% 12/6/2029	892.948	0,10	USD 685.000	Duke Energy Carolinas 3,55% 15/3/2052	498.966	0,06
USD 1.925.000	Capital One Financial 6,312% 8/6/2029	1.923.417	0,22	USD 980.000	Duke Energy Carolinas 3,75% 1/6/2045	746.378	0,08
USD 1.933.000	CenterPoint Energy Houston Electric 2,35% 1/4/2031	1.602.223	0,18	USD 500.000	Duke Energy Carolinas 4% 30/9/2042	406.212	0,05
USD 230.000	CenterPoint Energy Houston Electric 5,3% 1/4/2053	229.060	0,03	USD 1.400.000	Duke Energy Carolinas 5,4% 15/1/2054	1.375.213	0,16
USD 1.150.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5,375% 1/5/2047	920.085	0,11	USD 300.000	Duke Energy Florida 5,95% 15/11/2052	314.004	0,04
USD 4.062.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 6,384% 23/10/2035	3.939.123	0,45	USD 200.000	Duke Energy Progress 4% 1/4/2052	156.936	0,02
USD 1.800.000	Cheniere Energy Partners 4% 1/3/2031	1.590.602	0,18	USD 1.515.000	Eastman Chemical 5,75% 8/3/2033	1.495.150	0,17
USD 900.000	Cheniere Energy Partners 5,95% 30/6/2033	897.285	0,10	USD 3.015.000	Edison International 5,25% 15/11/2028	2.943.791	0,33
USD 700.000	Cigna 4,9% 15/12/2048	624.602	0,07	USD 1.575.000	Edison International 6,95% 15/11/2029	1.658.510	0,19
USD 3.950.000	Citigroup 3,98% 20/3/2030	3.630.894	0,41	USD 2.813.000	Elevance Health 2,25% 15/5/2030	2.347.887	0,27
USD 2.400.000	Citigroup 4,412% 31/3/2031	2.228.136	0,25	USD 1.295.000	Elevance Health 5,125% 15/2/2053	1.219.855	0,14
USD 2.405.000	Citigroup 6,174% 25/5/2034	2.402.769	0,27	USD 855.000	Energy Transfer 5,55% 15/2/2028	852.109	0,10
USD 300.000	Citigroup 6,675% 13/9/2043	315.434	0,04	USD 1.100.000	Energy Transfer 6% 15/6/2048	1.017.997	0,11

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 976.000	Energy Transfer 6,25% 15/4/2049	935.486	0,11	USD 700.000	Kinder Morgan Energy Partners 6,375% 1/3/2041	693.015	0,08
USD 1.210.000	Enterprise Products Operating 4,45% 15/2/2043	1.032.947	0,12	USD 970.000	Kinder Morgan Energy Partners 6,5% 1/2/2037	975.843	0,11
USD 1.660.000	Enterprise Products Operating 4,9% 15/5/2046	1.476.673	0,17	USD 1.000.000	Kraft Heinz Foods 7,125% 1/8/2039	1.097.220	0,12
USD 1.170.000	Equinix 2,15% 15/7/2030	945.200	0,11	USD 220.000	Lam Research 3,125% 15/6/2060	144.823	0,02
USD 500.000	Eversource Energy 5,125% 15/5/2033	483.922	0,06	EUR 140.344	Lehman Brothers 4,75% 16/1/2014***	792	0,00
GBP 2.800.000	Fiserv 2,25% 1/7/2025	3.320.725	0,38	USD 1.470.000	Lowe's 2,625% 1/4/2031	1.234.323	0,14
USD 2.370.000	Florida Power & Light 4,625% 15/5/2030	2.323.261	0,26	USD 340.000	Lowe's 2,8% 15/9/2041	233.981	0,03
USD 1.180.000	Florida Power & Light 5,95% 1/2/2038	1.240.971	0,14	USD 2.575.000	Lowe's 5,625% 15/4/2053	2.507.710	0,29
GBP 4.000.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	4.849.420	0,55	USD 215.000	Lowe's 5,75% 1/7/2053	213.057	0,02
USD 615.000	General Mills 4,95% 29/3/2033	599.686	0,07	USD 1.350.000	Marsh & McLennan 5,45% 15/3/2053	1.335.640	0,15
GBP 995.000	General Motors Financial 2,35% 3/9/2025	1.167.855	0,13	USD 1.100.000	Massachusetts Institute of Technology 3,067% 1/4/2052	789.337	0,09
EUR 1.500.000	General Motors Financial 4,3% 15/2/2029	1.594.064	0,18	USD 130.000	Merck 2,9% 10/12/2061	81.946	0,01
USD 3.000.000	General Motors Financial 6% 9/1/2028	3.006.883	0,34	USD 400.000	Microsoft 3,95% 8/8/2056	341.571	0,04
USD 3.200.000	Georgia Power 4,95% 17/5/2033	3.099.686	0,35	EUR 700.000	Morgan Stanley 0,406% 29/10/2027	674.068	0,08
USD 2.800.000	Gilead Sciences 4% 1/9/2036	2.475.608	0,28	USD 700.000	Morgan Stanley 2,484% 16/9/2036	528.937	0,06
USD 3.200.000	Glencore Funding 2,5% 1/9/2030	2.607.160	0,30	EUR 2.850.000	Morgan Stanley 2,95% 7/5/2032	2.804.963	0,32
USD 190.000	Global Payments 3,2% 15/8/2029	165.357	0,02	EUR 1.500.000	Morgan Stanley 4,813% 25/10/2028	1.663.535	0,19
EUR 4.320.000	Global Payments 4,875% 17/3/2031	4.685.701	0,53	USD 2.370.000	Morgan Stanley 5,123% 1/2/2029	2.321.507	0,26
USD 1.375.000	GLP Capital / GLP Financing II 4% 15/1/2031	1.180.570	0,13	EUR 5.350.000	Morgan Stanley 5,148% 25/1/2034	6.101.993	0,69
EUR 1.200.000	Goldman Sachs 1,25% 7/2/2029	1.107.510	0,13	USD 495.000	Motorola Solutions 2,3% 15/11/2030	394.663	0,05
USD 1.105.000	Goldman Sachs 2,383% 21/7/2032	873.608	0,10	USD 1.100.000	Motorola Solutions 5,6% 1/6/2032	1.085.357	0,12
USD 2.105.000	Goldman Sachs 2,65% 21/10/2032	1.690.200	0,19	USD 465.000	MPLX 5% 1/3/2033	439.055	0,05
USD 950.000	Goldman Sachs 3,615% 15/3/2028	888.342	0,10	USD 1.605.000	MPLX 5,65% 1/3/2053	1.456.163	0,16
USD 460.000	Goldman Sachs 3,691% 5/6/2028	430.500	0,05	USD 3.400.000	Nasdaq 5,35% 28/6/2028	3.396.387	0,39
USD 3.300.000	Goldman Sachs 4,017% 31/10/2038	2.744.282	0,31	USD 2.910.000	Nasdaq 5,55% 15/2/2034	2.902.120	0,33
USD 1.590.000	Goldman Sachs 6,75% 1/10/2037	1.692.656	0,19	USD 665.000	Nasdaq 5,95% 15/8/2053	663.429	0,08
USD 610.000	HCA 4,125% 15/6/2029	562.990	0,06	USD 1.140.000	Newmont 2,25% 1/10/2030	926.923	0,10
USD 900.000	HCA 5,5% 15/6/2047	819.985	0,09	USD 930.000	NiSource 1,7% 15/2/2031	718.796	0,08
USD 1.020.000	Home Depot 3,625% 15/4/2052	782.370	0,09	USD 975.000	NiSource 5,25% 30/3/2028	970.594	0,11
USD 175.000	Home Depot 4,95% 15/9/2052	167.626	0,02	USD 565.000	NiSource 5,4% 30/6/2033	560.193	0,06
USD 1.200.000	Intel 3,05% 12/8/2051	778.289	0,09	USD 420.000	Norfolk Southern 3,05% 15/5/2050	280.846	0,03
USD 3.220.000	Intel 5,7% 10/2/2053	3.195.915	0,36	USD 720.000	Norfolk Southern 4,65% 15/1/2046	628.235	0,07
USD 520.000	International Business Machines 4,25% 15/5/2049	428.868	0,05	USD 1.500.000	Northern States Power 2,6% 1/6/2051	920.441	0,10
USD 3.095.000	JPMorgan Chase 2,545% 8/11/2032	2.499.595	0,28	USD 780.000	Novartis Capital 4% 20/11/2045	669.428	0,08
USD 1.455.000	JPMorgan Chase 2,963% 25/1/2033	1.210.034	0,14	USD 2.670.000	NRG Energy 4,45% 15/6/2029	2.372.054	0,27
USD 1.400.000	JPMorgan Chase 4,586% 26/4/2033	1.312.622	0,15	USD 750.000	Nucor 3,95% 1/5/2028	712.820	0,08
USD 3.185.000	JPMorgan Chase 5,35% 1/6/2034	3.153.172	0,36	USD 3.900.000	Occidental Petroleum 8,875% 15/7/2030	4.471.721	0,51
USD 200.000	Kilroy Realty 2,5% 15/11/2032	140.733	0,02	USD 2.135.000	Ohio Power 1,625% 15/1/2031	1.670.560	0,19
EUR 5.100.000	Kinder Morgan 2,25% 16/3/2027*	5.161.474	0,59	USD 900.000	Ohio Power 5% 1/6/2033	877.344	0,10
USD 1.305.000	Kinder Morgan Energy Partners 5% 1/3/2043	1.107.302	0,12	USD 155.000	Omnicom 2,6% 1/8/2031	126.943	0,01
				USD 1.250.000	Oncor Electric Delivery 4,55% 15/9/2032	1.190.843	0,14
				USD 1.240.000	ONE Gas 4,25% 1/9/2032	1.155.145	0,13
				USD 600.000	ONEOK 6% 15/6/2035	591.371	0,07
				USD 1.900.000	ONEOK 6,625% 1/9/2053	1.923.625	0,22
				USD 1.820.000	Oracle 3,65% 25/3/2041	1.378.030	0,16
				USD 3.930.000	Oracle 6,9% 9/11/2052	4.292.972	0,49
				USD 1.607.000	Pacific Gas and Electric 3,25% 16/2/2024	1.587.367	0,18
				USD 1.400.000	Pacific Gas and Electric 6,15% 15/1/2033	1.360.629	0,15

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 5.580.000	Pacific Gas and Electric 6,4% 15/6/2033	5.522.889	0,63	USD 1.100.000	Union Pacific 2,891% 6/4/2036	867.978	0,10
USD 765.000	Pacific Gas and Electric 6,7% 1/4/2053	746.824	0,08	USD 750.000	Union Pacific 3,25% 5/2/2050	543.394	0,06
USD 3.250.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1,2% 15/11/2025	2.925.249	0,33	USD 500.000	Union Pacific 3,6% 15/9/2037	418.540	0,05
USD 845.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1,7% 15/6/2026	752.771	0,09	USD 1.790.000	Union Pacific 4,5% 20/1/2033	1.733.267	0,20
USD 4.500.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 5,75% 24/5/2026	4.466.759	0,51	USD 2.249.936	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027	2.247.002	0,26
USD 270.000	Pernod Ricard International Finance 2,75% 1/10/2050	166.934	0,02	USD 533.362	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026	513.361	0,06
USD 2.700.000	Philip Morris International 5,125% 15/2/2030	2.668.426	0,30	USD 1.300.000	UnitedHealth 2,9% 15/5/2050	865.188	0,10
USD 500.000	Progressive 4,95% 15/6/2033	492.038	0,06	USD 250.000	UnitedHealth 3,25% 15/5/2051	177.920	0,02
EUR 515.000	Prologis Euro Finance 1,5% 8/2/2034	412.866	0,05	USD 550.000	UnitedHealth 3,875% 15/8/2059	426.168	0,05
USD 700.000	QUALCOMM 6% 20/5/2053	755.219	0,08	USD 2.300.000	UnitedHealth 5,05% 15/4/2053	2.199.567	0,25
USD 1.020.000	Realty Income 4,85% 15/3/2030	987.490	0,11	USD 400.000	UnitedHealth 5,35% 15/2/2033	410.813	0,05
EUR 1.400.000	Realty Income 5,125% 6/7/2034	1.523.275	0,17	USD 3.165.000	Verizon Communications 2,55% 21/3/2031	2.604.405	0,30
USD 610.000	Sabine Pass Liquefaction 4,2% 15/3/2028	577.301	0,06	USD 1.510.000	VICI Properties 5,125% 15/5/2032	1.402.783	0,16
USD 1.595.000	Sabine Pass Liquefaction 5,9% 15/9/2037	1.602.841	0,18	USD 500.000	Virginia Electric and Power 4,2% 15/5/2045	403.639	0,05
USD 600.000	San Diego Gas & Electric 2,95% 15/8/2051	392.569	0,04	USD 1.200.000	Virginia Electric and Power 5,7% 15/8/2053	1.193.210	0,14
USD 4.285.000	San Diego Gas & Electric 4,95% 15/8/2028	4.244.290	0,48	USD 1.600.000	VMware 2,2% 15/8/2031	1.247.852	0,14
USD 600.000	San Diego Gas & Electric 5,35% 1/4/2053	582.614	0,07	USD 1.500.000	Walmart 4,5% 15/4/2053	1.399.118	0,16
USD 860.000	Sempra 6% 15/10/2039	861.866	0,10	USD 600.000	Waste Management 1,5% 15/3/2031	467.995	0,05
EUR 6.974.000	Southern 1,875% 15/9/2081	6.001.788	0,69	USD 2.400.000	Waste Management 4,875% 15/2/2034	2.341.739	0,27
USD 982.000	Southern California Edison 3,65% 1/2/2050	713.181	0,08	EUR 3.900.000	Wells Fargo 1,741% 4/5/2030	3.676.502	0,42
USD 600.000	Southern California Edison 4,125% 1/3/2048	473.931	0,05	USD 860.000	Wells Fargo 4,611% 25/4/2053	730.362	0,08
USD 920.000	Southern California Edison 5,7% 1/3/2053	894.246	0,10	USD 1.300.000	Wells Fargo 4,897% 25/7/2033	1.226.191	0,14
USD 970.000	Southern California Edison 5,95% 1/11/2032	1.006.087	0,11	USD 1.630.000	Wells Fargo 5,389% 24/4/2034	1.588.490	0,18
USD 1.300.000	Spectra Energy Partners 4,5% 15/3/2045	1.046.956	0,12	USD 3.955.000	Wells Fargo 5,574% 25/7/2029	3.936.031	0,45
USD 865.000	Tampa Electric 2,4% 15/3/2031	706.939	0,08	USD 2.140.000	Williams 4,65% 15/8/2032	2.010.302	0,23
USD 3.105.000	Targa Resources 4,2% 1/2/2033	2.738.684	0,31	USD 1.210.000	Wisconsin Power and Light 3,95% 1/9/2032	1.102.496	0,13
USD 1.900.000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 4,875% 1/2/2031	1.746.324	0,20	USD 300.000	WRKCo 3% 15/6/2033	243.072	0,03
USD 800.000	Thermo Fisher Scientific 4,95% 21/11/2032	800.314	0,09	USD 837.000	Wyeth 5,95% 1/4/2037	896.092	0,10
USD 910.000	Thomas Jefferson University 3,847% 1/11/2057	643.679	0,07			363.134.326	41,32
USD 700.000	T-Mobile USA 2,55% 15/2/2031	577.398	0,07	Total des obligations		843.910.430	96,03
USD 9.000.000	T-Mobile USA 2,875% 15/2/2031	7.564.251	0,86	BILLET DE TRÉSORERIE			
USD 520.000	T-Mobile USA 3,4% 15/10/2052	353.814	0,04	Canada			
USD 500.000	Travelers 4,3% 25/8/2045	425.624	0,05	USD 4.000.000	TELUS 0% 17/10/2023	3.970.395	0,45
				Allemagne			
				USD 5.095.000	BASF 0% 18/12/2023	5.008.379	0,57
				Total des billets de trésorerie		8.978.774	1,02
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		852.889.204	97,05
				Total du portefeuille		852.889.204	97,05
				Autres éléments de l'actif net		25.917.656	2,95
				Total de l'actif net (USD)		878.806.860	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Corporate Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
CAD	770.000	USD	585.264	UBS	5/9/2023	(16.089)
EUR	1.500.000	USD	1.640.663	Nomura	5/9/2023	(13.167)
EUR	6.800.000	USD	7.453.840	UBS	5/9/2023	(75.856)
EUR	3.000.000	USD	3.249.001	Barclays	5/9/2023	5.993
GBP	1.200.000	USD	1.523.698	UBS	5/9/2023	(2.511)
USD	249.387	PLN	1.010.000	Goldman Sachs	5/9/2023	4.200
USD	356.301	CHF	310.000	JP Morgan	5/9/2023	5.271
USD	4.080.796	AUD	6.150.000	UBS	5/9/2023	96.976
USD	2.968.291	CAD	3.930.000	Deutsche Bank	5/9/2023	63.285
USD	73.026	JPY	10.150.000	BNP Paribas	5/9/2023	3.568
USD	324.251.843	EUR	295.520.000	State Street	5/9/2023	3.613.304
USD	102.261.280	GBP	79.990.000	Morgan Stanley	5/9/2023	861.495
USD	2.241.881	EUR	2.030.000	UBS	5/9/2023	39.336
USD	1.068.125	GBP	830.000	UBS	5/9/2023	15.970
USD	362.842	EUR	330.000	Barclays	5/9/2023	4.793
USD	587.317	GBP	460.000	HSBC Bank	5/9/2023	4.195
USD	2.183.277	EUR	2.000.000	Deutsche Bank	5/9/2023	13.281
USD	353.778	CHF	310.000	Citigroup	4/10/2023	1.641
USD	3.977.457	AUD	6.150.000	State Street	4/10/2023	(10.615)
USD	244.882	PLN	1.010.000	RBS	4/10/2023	89
USD	69.688	JPY	10.150.000	BNP Paribas	4/10/2023	(93)
USD	101.253.232	GBP	80.080.000	BNY Mellon	4/10/2023	(274.034)
USD	2.330.816	CAD	3.160.000	JP Morgan	4/10/2023	(6.059)
USD	313.955.417	EUR	288.580.000	BNP Paribas	4/10/2023	406.999
Plus-value nette non réalisée						4.741.972
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	24.814.625	USD	16.156.691	BNY Mellon	15/9/2023	(76.438)
USD	797.134	AUD	1.239.213	BNY Mellon	15/9/2023	(5.891)
Moins-value nette non réalisée						(82.329)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	1.517.572	USD	1.128.471	BNY Mellon	15/9/2023	(6.526)
USD	13.076	CAD	17.657	BNY Mellon	15/9/2023	21
Moins-value nette non réalisée						(6.505)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	1.060.505.954	USD	146.959.769	BNY Mellon	15/9/2023	(1.109.211)
USD	3.980.585	CNY	28.914.381	BNY Mellon	15/9/2023	4.029
Moins-value nette non réalisée						(1.105.182)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	231.815.524	USD	254.182.538	BNY Mellon	15/9/2023	(2.540.057)
USD	31.883.891	EUR	29.283.803	BNY Mellon	15/9/2023	95.594
Moins-value nette non réalisée						(2.444.463)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	21.593.651	USD	27.475.528	BNY Mellon	15/9/2023	(100.962)
USD	334.587	GBP	263.472	BNY Mellon	15/9/2023	580
Moins-value nette non réalisée						(100.382)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	25.636.915	USD	3.284.855	BNY Mellon	15/9/2023	(14.320)
USD	38.896	HKD	304.149	BNY Mellon	15/9/2023	95
Moins-value nette non réalisée						(14.225)
Catégorie d'Actions couverte en NOK						
NOK	76.730.846	USD	7.471.541	BNY Mellon	15/9/2023	(263.406)
USD	91.311	NOK	961.497	BNY Mellon	15/9/2023	989
Moins-value nette non réalisée						(262.417)

Global Corporate Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	4.777.912	USD	2.886.472	BNY Mellon	15/9/2023	(44.736)
USD	32.170	NZD	54.129	BNY Mellon	15/9/2023	(24)
Moins-value nette non réalisée						(44.760)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	221.286	USD	20.710	BNY Mellon	15/9/2023	(414)
USD	1.159	SEK	12.568	BNY Mellon	15/9/2023	6
Moins-value nette non réalisée						(408)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	25.668.391	USD	19.067.801	BNY Mellon	15/9/2023	(68.766)
USD	302.442	SGD	409.963	BNY Mellon	15/9/2023	(1.001)
Moins-value nette non réalisée						(69.767)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.383.103.168)						611.534

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(111)	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	13.973.367	(63.000)
(271)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	39.104.681	(88.480)
(21)	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	3.040.732	60.106
107	EUR	Euro Schatz	Septembre 2023	12.200.388	25.128
8	AUD	Australian 10 Year Bond	Septembre 2023	602.935	6.538
(25)	AUD	Australian 3 Year Bond	Septembre 2023	1.723.277	(5.703)
173	CAD	Canadian 10 Year Bond	Décembre 2023	15.257.060	78.331
257	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	31.241.562	413.127
70	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	7.762.344	57.454
(327)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	37.926.891	(464.968)
137	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	17.737.219	279.610
(216)	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	26.102.536	(237.913)
217	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	44.196.797	85.304
853	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	91.104.398	558.483
Total				341.974.187	704.017

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR 5.350.000	Fund receives default protection on ENI; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(64.804)	(100.066)
CDS	EUR 2.494.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(34.348)	(33.637)
CDS	EUR 4.500.000	Fund receives default protection on Unibail-Rodamco; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2024	(17.467)	(12.499)
CDS	EUR 7.820.000	Fund receives default protection on Compass; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(43.283)	(263.970)
CDS	EUR 5.930.000	Fund receives default protection on Stellantis; and pays Fixed 5%	Barclays	20/6/2028	(54.292)	(982.783)
CDS	EUR 3.200.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(46.762)	148.135
CDS	EUR 4.600.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(73.174)	212.944
CDS	EUR 5.500.000	Fund receives default protection on Akzo Nobel; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(76.914)	(50.971)
CDS	EUR 5.170.000	Fund receives default protection on Next; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2028	(116.210)	3.852

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Corporate Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 4.775.000	Fund receives default protection on Shermin-Williams; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2028	(49.907)	(69.995)
CDS	EUR (2.360.000)	Fund provides default protection on Rolls-Royce; and receives Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	3.181	(91.925)
CDS	EUR 5.700.000	Fund receives default protection on Aegon; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(36.267)	(62.481)
CDS	EUR 1.600.000	Fund receives default protection on Bacred; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(13.861)	51.095
CDS	USD 7.181.009	Fund receives default protection on Dell; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(162.411)	16.106
CDS	USD 1.288.991	Fund receives default protection on Dell; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(28.153)	2.891
CDS	EUR 1.156.000	Fund receives default protection on HSBC; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(5.291)	10.597
CDS	EUR 770.000	Fund receives default protection on HSBC; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(2.436)	7.058
CDS	USD 3.590.504	Fund receives default protection on Kroger; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(10.845)	(60.044)
CDS	USD 4.879.496	Fund receives default protection on Kroger; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(12.920)	(81.600)
CDS	EUR (3.900.000)	Fund provides default protection on Barclays Bank; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	59.699	(280)
CDS	EUR (4.800.000)	Fund provides default protection on Glencore International; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(1.643)	747.206
CDS	EUR 2.000.000	Fund receives default protection on Banco BPM; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(6.608)	(168.133)
CDS	EUR 3.900.000	Fund receives default protection on Barclays; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(49.768)	10.985
CDS	EUR 7.900.000	Fund receives default protection on Bouygues; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(68.286)	(209.734)
CDS	EUR 1.850.000	Fund receives default protection on Standard Chart; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(35.895)	28.551
CDS	USD 5.050.000	Fund receives default protection on Whirlpool; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(64.203)	73.569
CDS	EUR 3.450.000	Fund receives default protection on Akzo Nobel; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(35.381)	(31.972)
CDS	EUR 11.220.000	Fund receives default protection on ITRAXX.EUR.39.V1; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(93.592)	(159.689)
CDS	EUR 6.656.000	Fund receives default protection on ITRAXX.XO.39.V1; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	(163.664)	(298.260)
CDS	EUR 6.200.000	Fund receives default protection on Next; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(156.947)	4.619
CDS	EUR 3.625.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(28.884)	(48.891)
CDS	EUR 5.900.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(47.012)	(79.575)
CDS	EUR 1.750.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(52.077)	81.011
IFS	USD 51.870.000	Fund receives default protection US CPIU + 0bps; and pays Fixed 2,5%	Morgan Stanley	17/4/2024	(64.785)	(64.785)
IFS	EUR 2.930.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,758%	Morgan Stanley	15/6/2053	23.919	23.919
IRS	CAD 13.860.000	Fund receives Fixed 0,942%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Morgan Stanley	8/2/2026	(982.753)	(982.753)
IRS	CHF 1.600.000	Fund receives Fixed -0,268%; and pays Floating CHF SARON 1 Day	Morgan Stanley	25/11/2026	(114.746)	(114.746)
IRS	CHF 810.000	Fund receives Fixed 0,072%; and pays Floating CHF SARON 1 Day	Morgan Stanley	25/11/2031	(115.829)	(115.829)
IRS	EUR 1.910.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,2705%	Morgan Stanley	4/3/2053	188.720	188.720
TRS	EUR 6.955.000	Fund receives EUR EURIBOR 3 Month + 0bps; and pays iBoxx Euro Liquid High Yield + 0bps	JP Morgan	20/9/2023	(43.281)	(31.880)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 233.272.495)					(2.699.180)	(2.505.240)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Global Corporate Bond Fund suite

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Moins-valeur non réalisée USD	Valeur de marché USD
EUR 63.120.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.EUR.39.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 1% Fixed	Morgan Stanley	20/9/2023	(73.509)	42.416
USD 51.000.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Morgan Stanley	20/9/2023	(491.695)	31.054
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 25.850.594)				(565.204)	73.470

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (51.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Morgan Stanley	20/9/2023	157.613	(10.687)
USD (51.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Morgan Stanley	20/9/2023	304.780	(16.520)
USD (25.000.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,75% Fixed semi-annually from 13/11/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 13/5/2025	JP Morgan	9/5/2024	(179.842)	(322.342)
USD (25.000.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 13/5/2025; and pays 2,25% Fixed semi-annually from 13/11/2024	JP Morgan	9/5/2024	133.117	(26.883)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 21.251.205)				415.668	(376.432)

Global Dynamic Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				523.300	Mitsubishi UFJ Financial*	4.165.849	1,02
				47.300	Mitsui*	1.757.953	0,43
				4.100	SMC*	1.980.501	0,48
				33.000	Systemex	1.750.081	0,43
				142.600	Toyota Motor*	2.453.827	0,60
						25.148.096	6,15
ACTIONS ORDINAIRES / PRIVILEGIEES ET WARRANTS							
Bermudes							
21.367	Bunge	2.450.581	0,60				
Canada							
34.748	Cameco	1.292.973	0,32				
138.241	Enbridge*	4.892.591	1,20				
54.326	Suncor Energy*	1.848.403	0,45				
9.351	Teck Resources	391.152	0,09				
						3.958.174	0,96
				Pays-Bas			
		8.425.119	2,06	958	Adyen	809.779	0,20
				6.016	ASML	4.006.944	0,98
				385.820	ING Groep	5.539.667	1,35
				4.100	LyondellBasell Industries	407.499	0,10
						10.763.889	2,63
				Corée du Sud			
		2.241.609	0,55	8.485	Amorepacific	859.574	0,21
				16.913	SK Hynix	1.558.542	0,38
						2.418.116	0,59
				Espagne			
		1.629.687	0,40	106.706	Cellnex Telecom	4.114.472	1,01
				Suisse			
		244.598	0,06	36.960	Alcon	3.105.077	0,76
				15.234	Chubb	3.081.838	0,75
				1.386	Lonza*	771.457	0,19
				54.530	Nestle	6.590.208	1,61
				3.244	Roche	962.869	0,24
				16.844	TE Connectivity	2.238.736	0,55
				44.815	Transocean*	368.379	0,09
						17.118.564	4,19
				Taiwan			
		1.629.687	0,40	157.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	2.706.512	0,66
				Royaume-Uni			
		244.598	0,06	14.154	AstraZeneca	973.937	0,24
				18.083	AstraZeneca	2.465.130	0,60
				569.511	BAE Systems	7.304.617	1,78
				462.437	Barclays	871.223	0,21
				65.766	Compass	1.677.170	0,41
				540.034	Lloyds Banking*	291.320	0,07
				52.945	RELX	1.732.928	0,43
				30.469	Shell*	1.894.258	0,46
				151.768	Shell*	4.719.155	1,16
				91.951	Unilever	4.751.637	1,16
						26.681.375	6,52
				États-Unis			
		244.598	0,06	36.827	Abbott Laboratories	3.844.739	0,94
				6.506	AbbVie	966.857	0,24
				16.737	Advanced Micro Devices	1.797.554	0,44
				10.093	Air Products and Chemicals	2.985.005	0,73
				9.421	Albemarle	1.873.366	0,46
				81.444	Alphabet†	11.225.426	2,75
				76.010	Amazon.com	10.471.138	2,56
				14.630	American Tower	2.670.414	0,65
				76.153	Apple†	14.321.333	3,50
				13.128	Applied Materials	1.994.800	0,49
				34.020	Archer-Daniels-Midland	2.732.827	0,67
				18.704	Astra Space	4.947	0,00
				2.415	Atlas Energy Solutions	51.271	0,01
				900	Ball*	48.942	0,01
				18.542	Booz Allen Hamilton	2.129.549	0,52
				80.221	Boston Scientific	4.368.835	1,07
						2.861.444	0,70
Japon							
75.600	FANUC	2.148.177	0,53				
51.900	Honda Motor	1.670.047	0,41				
13.654	Hoya*	1.509.222	0,37				
146.700	Japan Airlines	3.012.191	0,74				
7.128	Keyence	2.951.570	0,72				
27.500	Komatsu	780.849	0,19				
11.700	Kose*	967.829	0,23				

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Dynamic Equity Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
OBLIGATIONS			
Îles Caïmans			
CNY 5.600.000	Fresh Express Delivery 0% 18/10/2010**.*	–	0,00
Inde			
USD 1.215.000	REI Agro 5,5% 13/11/2014**.*	–	0,00
Total des obligations		–	0,00
Total des autres valeurs mobilières		9.489.940	2,32
Total du portefeuille		372.915.883	91,19
Autres éléments de l'actif net		36.014.706	8,81
Total de l'actif net (USD)		408.930.589	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	18.598.474	USD	12.631.228	Barclays	20/9/2023	(576.941)
BRL	7.402.067	USD	1.456.584	Morgan Stanley	20/9/2023	41.904
BRL	8.221.678	USD	1.687.419	JP Morgan	20/9/2023	(23.008)
CAD	9.255.000	USD	6.941.891	HSBC Bank	20/9/2023	(99.130)
CHF	5.306.001	USD	6.052.700	HSBC Bank	20/9/2023	(34.612)
CNY	21.930.712	USD	3.040.965	BNP Paribas	20/9/2023	(14.766)
DKK	11.070.726	USD	1.645.193	Bank of America	20/9/2023	(31.853)
DKK	15.242.055	USD	2.237.006	JP Morgan	20/9/2023	(15.778)
EUR	938.624	USD	1.020.851	Morgan Stanley	20/9/2023	(1.707)
EUR	3.611.149	USD	3.917.597	HSBC Bank	20/9/2023	3.338
JPY	2.437.984.375	USD	18.490.776	JP Morgan	20/9/2023	(1.767.175)
KRW	2.612.908.492	USD	1.994.571	UBS	20/9/2023	(17.413)
KRW	2.845.604.005	USD	2.153.302	Morgan Stanley	20/9/2023	(66)
SEK	18.504.737	USD	1.821.428	Bank of America	20/9/2023	(123.841)
SGD	2.224.767	USD	1.649.862	BNP Paribas	20/9/2023	(2.780)
TWD	72.166.410	USD	2.383.303	JP Morgan	20/9/2023	(116.854)
USD	3.191.448	CNY	21.930.712	BNP Paribas	20/9/2023	165.249
USD	1.661.561	HKD	12.967.655	UBS	20/9/2023	6.861
USD	58.715	GBP	46.425	Morgan Stanley	20/9/2023	(140)
USD	23.049.754	EUR	20.853.518	BNP Paribas	20/9/2023	407.298
USD	1.007.957	GBP	805.760	HSBC Bank	20/9/2023	(13.539)
USD	1.009.102	CHF	892.273	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.918)
USD	1.028.104	JPY	140.866.736	BNP Paribas	20/9/2023	61.814
USD	1.243.824	JPY	174.140.061	State Street	20/9/2023	49.293
USD	3.223.264	JPY	463.963.255	JP Morgan	20/9/2023	40.661
USD	3.100.173	JPY	443.590.227	Royal Bank of Canada	20/9/2023	57.321
USD	1.731.560	CHF	1.544.112	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(19.778)
USD	1.238.066	JPY	174.074.457	Morgan Stanley	20/9/2023	43.984
USD	1.021.299	JPY	143.217.816	Deutsche Bank	20/9/2023	38.882
USD	1.645.366	CAD	2.225.698	Morgan Stanley	20/9/2023	(222)
USD	1.277.797	GBP	1.004.302	Goldman Sachs	20/9/2023	4.600
USD	2.802.232	CHF	2.456.152	JP Morgan	20/9/2023	16.454
USD	2.456.283	AUD	3.785.853	JP Morgan	20/9/2023	2.547
USD	931.078	HKD	7.297.167	Bank of America	20/9/2023	(56)
Moins-value nette non réalisée						(1.922.371)

Global Dynamic Equity Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	665.551	USD	91.518	BNY Mellon	15/9/2023	13
USD	1.471	CNY	10.716	BNY Mellon	15/9/2023	(2)
Plus-value nette non réalisée						11
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	12.297.339	USD	13.489.550	BNY Mellon	15/9/2023	(140.429)
USD	839.342	EUR	769.531	BNY Mellon	15/9/2023	3.996
Moins-value nette non réalisée						(136.433)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 131.274.058)						(2.058.793)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
1	CAD	S&P/TSX 60 Index	Septembre 2023	180.891	5.642
(1)	EUR	Dax Index	Septembre 2023	435.606	10.822
(71)	GBP	FTSE 100 Index	Septembre 2023	6.748.436	102.041
85	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	19.276.937	429.315
23	USD	Nifty 50 Index	Septembre 2023	894.654	1.958
29	JPY	Nikkei 225 (Yen)	Septembre 2023	3.240.191	101.445
Total				30.776.715	651.223

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
119.565	Call	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 239,439	10/11/2023	1.041	8.830
199.196	Call	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 239,3	10/11/2023	1.420	14.802
79.790	Call	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 239,43	10/11/2023	1.353	5.895
25	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	(13.997)	2.550
42	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	(40.057)	357
20	Call	Albemarle	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(11.843)	900
74	Call	Alibaba	Exchange Traded	USD 100	15/9/2023	(32.373)	5.365
90	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	81.654	118.800
100	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	48.988	84.750
80	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(10.098)	37.000
83	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	15/9/2023	(28.608)	5.187
112	Call	Apple	Exchange Traded	USD 195	15/9/2023	(51.042)	8.792
50	Call	Apple	Exchange Traded	USD 200	15/9/2023	(20.134)	1.375
117	Call	Apple	Exchange Traded	USD 205	15/9/2023	(31.090)	1.346
32	Call	Applied Materials	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	22.704	40.320
76	Call	Archer-Daniels-Midland	Exchange Traded	USD 82,5	15/9/2023	(10.049)	3.040
29	Put	Crowdstrike	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(15.333)	537
49	Call	Edwards Lifesciences	Exchange Traded	USD 85	15/9/2023	(13.260)	490
15	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	111.909	134.925
20	Call	Humana	Exchange Traded	USD 450	15/9/2023	31.480	50.200
5	Call	Humana	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	809	7.975
149	Call	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	(28.487)	522
15	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 355	15/9/2023	(18.101)	608
76	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 365	15/9/2023	(76.864)	1.330
76	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	334.421	524.210
5	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	546	13.412
5	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 485	15/9/2023	(3.373)	11.800

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Dynamic Equity Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
45	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(43.855)	69.637
25	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 470	15/9/2023	20.569	84.750
24	Put	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 210	15/9/2023	(25.544)	288
153	Call	Pfizer	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(24.439)	383
183	Call	Pfizer	Exchange Traded	USD 42,5	15/9/2023	(19.164)	275
10	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 230	15/9/2023	(8.660)	3.225
10	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 240	15/9/2023	(7.639)	810
23	Call	Starbucks	Exchange Traded	USD 105	15/9/2023	(5.875)	196
8	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 275	15/9/2023	(7.387)	2.780
8	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 280	15/9/2023	(12.118)	2.060
30	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 290	15/9/2023	(52.687)	4.230
50	Call	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	(986)	15.125
19	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 120	15/9/2023	8.128	19.000
100	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	22.719	58.500
25	Call	Walt Disney	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	(6.893)	388
24	Put	Zscaler	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(9.953)	10.740
97	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	7.010	37.587
147	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	26.135	106.575
58	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 140	20/10/2023	5.816	28.275
117	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(36.430)	33.988
48	Call	Apple	Exchange Traded	USD 185	20/10/2023	21.706	38.520
49	Call	Bunge	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	35.908	57.820
147	Call	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 125	20/10/2023	(9.074)	26.533
49	Put	Fortinet	Exchange Traded	USD 55	20/10/2023	(10.399)	2.940
147	Call	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 45	20/10/2023	(31.546)	8.379
29	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 345	20/10/2023	(742)	15.660
24	Call	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 320	20/10/2023	(1.191)	19.440
9	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 435	20/10/2023	(3.618)	2.785
146	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(12.442)	17.812
20	Call	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 530	20/10/2023	(21.235)	5.110
25	Call	Humana	Exchange Traded	USD 520	17/11/2023	(31.306)	12.500
25	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 440	15/12/2023	107.944	214.250
153	Call	Pfizer	Exchange Traded	USD 47	19/1/2024	(10.210)	1.453
255	Call	Pfizer	Exchange Traded	USD 50	19/1/2024	(10.173)	1.402
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 21.200.067)						83.985	1.988.734

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(119.565)	Call	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 262,243	10/11/2023	984	(2.740)
(199.196)	Call	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 262,09	10/11/2023	1.635	(4.604)
(79.790)	Call	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 262,232	10/11/2023	0	(1.829)
(40)	Put	Albemarle	Exchange Traded	USD 180	15/9/2023	11.601	(2.200)
(74)	Call	Alibaba	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	12.205	(555)
(178)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(52.462)	(79.210)
(150)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(5.745)	(25.200)
(158)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	25.797	(3.081)
(116)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	14.057	(406)
(86)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	7.075	(2.623)
(62)	Call	Applied Materials	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	(14.786)	(29.295)
(27)	Call	CF Industries	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	3.972	(270)
(29)	Call	CrowdStrike	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	7.275	(2.407)
(29)	Put	CrowdStrike	Exchange Traded	USD 120	15/9/2023	4.009	(44)
(15)	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(70.946)	(75.937)
(10)	Call	Humana	Exchange Traded	USD 490	15/9/2023	3.608	(1.875)

Global Dynamic Equity Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(149)	Call	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 170	15/9/2023	5.413	(224)
(17)	Call	KLA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	9.077	(1.190)
(49)	Call	Micron Technology	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	5.087	(270)
(41)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	15/9/2023	12.352	(1.292)
(11)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	7.780	(2.805)
(11)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 560	15/9/2023	10.571	(1.892)
(25)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 600	15/9/2023	19.404	(988)
(39)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 540	15/9/2023	27.174	(14.820)
(50)	Put	NVIDIA	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	63.057	(1.400)
(24)	Call	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 260	15/9/2023	3.659	(1.332)
(24)	Put	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	10.131	(120)
(336)	Put	Pfizer	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	7.203	(6.552)
(21)	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 250	15/9/2023	8.977	(441)
(16)	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 305	15/9/2023	8.074	(968)
(45)	Put	Tesla	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	14.007	(2.993)
(50)	Call	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	1.749	(750)
(30)	Put	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 70	15/9/2023	3.413	(270)
(38)	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	(2.289)	(10.298)
(50)	Call	Walt Disney	Exchange Traded	USD 95	15/9/2023	6.972	(275)
(24)	Call	Zscaler	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	3.342	(5.964)
(24)	Put	Zscaler	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	5.646	(3.540)
(193)	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	(2.071)	(20.361)
(48)	Put	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 95	20/10/2023	8.637	(8.736)
(147)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(6.943)	(37.191)
(147)	Put	Alphabet	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	13.564	(5.218)
(116)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 155	20/10/2023	(1.419)	(9.976)
(117)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	15.350	(5.206)
(143)	Put	Amazon.com	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	11.558	(10.868)
(97)	Call	Apple	Exchange Traded	USD 200	20/10/2023	(10.544)	(14.986)
(24)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	1.734	(1.044)
(49)	Call	Bunge	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	(4.962)	(8.575)
(147)	Call	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	4.744	(4.483)
(147)	Put	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	16.798	(9.481)
(49)	Call	Fortinet	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	1.998	(1.715)
(49)	Put	Fortinet	Exchange Traded	USD 45	20/10/2023	1.655	(490)
(147)	Call	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	13.336	(1.985)
(98)	Put	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 38	20/10/2023	(2.081)	(10.486)
(58)	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 370	20/10/2023	1.292	(7.337)
(15)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	20/10/2023	3.004	(3.443)
(24)	Call	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 350	20/10/2023	1.329	(2.880)
(24)	Put	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 270	20/10/2023	3.296	(2.820)
(146)	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 57,5	20/10/2023	5.149	(2.409)
(146)	Put	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 37,5	20/10/2023	3.251	(2.701)
(20)	Call	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 560	20/10/2023	7.775	(1.080)
(20)	Put	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 450	20/10/2023	(895)	(7.450)
(25)	Call	Humana	Exchange Traded	USD 560	17/11/2023	11.819	(3.125)
(25)	Put	Humana	Exchange Traded	USD 440	17/11/2023	(4.681)	(19.875)
(55)	Call	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 82,5	17/11/2023	2.682	(550)
(55)	Put	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 65	17/11/2023	(1.415)	(8.112)
(25)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 530	15/12/2023	(53.181)	(99.125)
(25)	Put	NVIDIA	Exchange Traded	USD 310	15/12/2023	23.407	(4.288)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 10.573.641)						243.264	(606.656)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Dynamic Equity Fund suite

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
France			
(1.519)	Pernod Ricard	JP Morgan	22.665
			<u>22.665</u>
États-Unis			
1.305	Banc of California	JP Morgan	983
(766)	Bank of America	JP Morgan	1.796
(590)	Bank of Hawaii	JP Morgan	920
(609)	BankUnited	JP Morgan	2.229
(440)	Banner	JP Morgan	1.778
(851)	Charles Schwab	JP Morgan	4.944
(9.032)	Cloudflare	JP Morgan	9.393
(887)	Community Bank System	JP Morgan	5.836
(784)	FB Financial	JP Morgan	2.979
(714)	Glacier Bancorp	JP Morgan	2.342
(4.215)	Huntington Bancshares	JP Morgan	3.794
(600)	Independent Bank	JP Morgan	1.053

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(1.285)	J M Smucker	JP Morgan	3.919
(756)	OceanFirst Financial	JP Morgan	968
(1.129)	Pacific Premier Bancorp	JP Morgan	3.172
(1.987)	PacWest Bancorp	JP Morgan	(1.298)
(25.766)	Palantir Technologies	JP Morgan	51.403
(336)	Prosperity Bancshares	JP Morgan	1.337
(1.200)	Simmons First National	JP Morgan	1.968
(1.924)	Snowflake	JP Morgan	(1.982)
(1.453)	Truist Financial	JP Morgan	2.681
(4.942)	Valley National Bancorp	JP Morgan	4.117
(791)	Washington Federal	JP Morgan	2.460
(151)	Western Alliance Bancorp	JP Morgan	304
(275)	Zions Bancorp	JP Morgan	789
			<u>107.885</u>
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.310.210)			130.550

Global Equity Income Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Canada				Royaume-Uni			
1.143.691	TELUS	20.263.975	2,20	201.177	AstraZeneca	27.425.068	2,98
				1.429.042	Prudential	17.826.711	1,94
				633.410	RELX	20.760.770	2,26
				645.613	Shell*	20.075.033	2,19
				13.639.343	Taylor Wimpey	19.900.690	2,16
				105.988.272 11,53			
Danemark				États-Unis			
98.306	Novo Nordisk	18.288.841	1,99	150.610	AbbVie	22.382.152	2,44
				86.570	American Express	13.871.111	1,51
				178.855	Apple	33.635.471	3,66
				97.502	Assurant	13.555.703	1,48
				552.264	Baker Hughes	19.950.537	2,17
				320.631	Carrier Global	18.503.615	2,01
				528.579	Citizens Financial	14.884.785	1,62
				209.036	Intercontinental Exchange	24.664.157	2,68
				103.196	M&T Bank	12.970.705	1,41
				131.664	Microsoft	43.325.356	4,71
				398.904	Mondelez International	28.413.932	3,09
				205.328	Oracle	24.824.155	2,70
				229.420	Otis Worldwide	19.860.889	2,16
				196.409	Paychex	23.999.216	2,61
				123.947	Republic Services	18.066.515	1,97
				288.482	Synchrony Financial	9.378.550	1,02
				60.948	Union Pacific	13.561.540	1,47
				112.616	United Parcel Service	19.378.961	2,11
				52.965	UnitedHealth	25.952.850	2,82
				308.333	Williams	10.756.197	1,17
				411.936.397 44,81			
				Total des actions ordinaires			
				885.726.537 96,36			
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
				885.726.537 96,36			
				Total du portefeuille			
				885.726.537 96,36			
				Autres éléments de l'actif net			
				33.448.838 3,64			
				Total de l'actif net (USD)			
				919.175.375 100,00			
France							
110.527	Air Liquide	20.186.616	2,20				
104.262	EssilorLuxottica	19.895.292	2,16				
23.541	Kering*	12.730.760	1,39				
11.439	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	9.854.086	1,07				
229.737	Sanofi	24.803.073	2,70				
				87.469.827 9,52			
Indonésie							
29.007.600	Bank Rakyat Indonesia Persero	10.570.727	1,15				
Irlande							
82.672	Accenture	26.894.855	2,93				
227.325	Medtronic	18.742.946	2,04				
				45.637.801 4,97			
Jersey							
85.129	Ferguson*	13.947.856	1,52				
Mexique							
4.815.230	Wal-Mart de Mexico	19.660.289	2,14				
Pays-Bas							
5.610.497	Koninklijke KPN	19.667.362	2,14				
Singapour							
530.179	DBS	13.061.168	1,42				
Suisse							
30.314	Lonza	16.872.972	1,83				
228.947	Nestlé	27.669.329	3,01				
110.387	TE Connectivity	14.671.536	1,60				
40.701	Zurich Insurance	19.198.214	2,09				
				78.412.051 8,53			
Taiwan							
725.000	MediaTek	16.049.631	1,75				
1.437.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	24.772.340	2,69				
				40.821.971 4,44			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Global Equity Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	19.918.751	USD	12.969.424	BNY Mellon	15/9/2023	(61.770)
USD	736.962	AUD	1.142.671	BNY Mellon	15/9/2023	(3.505)
Moins-value nette non réalisée						(65.275)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	9.150.829	USD	10.476.466	BNY Mellon	15/9/2023	(103.066)
USD	489.078	CHF	429.403	BNY Mellon	15/9/2023	2.308
Moins-value nette non réalisée						(100.758)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	24.241.811	USD	3.358.100	BNY Mellon	15/9/2023	(24.143)
USD	185.015	CNY	1.348.860	BNY Mellon	15/9/2023	(491)
Moins-value nette non réalisée						(24.634)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	52.877.070	USD	58.003.194	BNY Mellon	15/9/2023	(603.587)
USD	3.521.097	EUR	3.235.345	BNY Mellon	15/9/2023	9.051
Moins-value nette non réalisée						(594.536)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	904.141	USD	1.150.249	BNY Mellon	15/9/2023	(4.056)
USD	53.576	GBP	42.197	BNY Mellon	15/9/2023	81
Moins-value nette non réalisée						(3.975)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	6.957.210	USD	891.328	BNY Mellon	15/9/2023	(3.788)
USD	41.640	HKD	325.812	BNY Mellon	15/9/2023	76
Moins-value nette non réalisée						(3.712)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	44.883.255	USD	11.046.204	BNY Mellon	15/9/2023	(156.507)
USD	566.743	PLN	2.326.037	BNY Mellon	15/9/2023	2.390
Moins-value nette non réalisée						(154.117)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	85.518.496	USD	63.520.098	BNY Mellon	15/9/2023	(221.672)
USD	3.157.002	SGD	4.277.598	BNY Mellon	15/9/2023	(9.147)
Moins-value nette non réalisée						(230.819)
Catégorie d'Actions couverte en ZAR						
USD	103.919	ZAR	1.972.402	BNY Mellon	15/9/2023	(953)
ZAR	29.003.241	USD	1.537.958	BNY Mellon	15/9/2023	4.098
Plus-value nette non réalisée						3.145
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 170.549.041)						(1.174.681)

Global Equity Income Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	27,32
Technologie	21,05
Finance	16,32
Valeurs industrielles	11,32
Biens de consommation cyclique	8,28
Énergie	5,53
Communications	4,34
Matériaux de base	2,20
Autres éléments de l'actif net	3,64
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
Argentine							
USD 164.000	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2035*	49.206	0,01	EUR 3.689.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0% 22/10/2031	3.152.056	0,31
USD 139.000	Argentine Republic Government International Bond 4,25% 9/1/2038	49.005	0,00	EUR 2.128.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,1% 22/6/2030	1.912.695	0,19
USD 74.456	Generacion Mediterranea SA / Central Termica Roca 9,875% 1/12/2027	64.927	0,01	EUR 510.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,4% 22/6/2040	340.404	0,03
USD 72.085	YPF 7% 30/9/2033	55.670	0,01	EUR 2.560.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,5% 22/10/2024*	2.689.692	0,26
USD 65.000	YPF 7% 15/12/2047	44.719	0,00	EUR 1.330.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,65% 22/6/2071	556.917	0,06
		263.527	0,03	EUR 1.290.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,8% 22/6/2027*	1.295.311	0,13
Australie				EUR 1.506.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,8% 22/6/2028	1.488.373	0,15
AUD 1.627.000	Australia Government Bond 0,25% 21/11/2024	1.007.990	0,10	EUR 350.000	Kingdom of Belgium Government Bond 0,9% 22/6/2029	340.600	0,03
AUD 2.515.000	Australia Government Bond 0,25% 21/11/2025*	1.507.907	0,15	EUR 2.200.000	Kingdom of Belgium Government Bond 1% 22/6/2026	2.264.072	0,22
AUD 1.320.000	Australia Government Bond 1,75% 21/6/2051	494.025	0,05	EUR 250.000	Kingdom of Belgium Government Bond 1,4% 22/6/2053	165.739	0,02
AUD 380.000	Australia Government Bond 2,75% 21/4/2024	244.250	0,02	EUR 600.000	Kingdom of Belgium Government Bond 1,6% 22/6/2047	454.433	0,04
AUD 2.720.000	Australia Government Bond 2,75% 21/11/2027	1.694.580	0,17	EUR 340.000	Kingdom of Belgium Government Bond 1,7% 22/6/2050	253.065	0,03
AUD 609.000	Australia Government Bond 2,75% 21/11/2029	371.005	0,04	EUR 130.000	Kingdom of Belgium Government Bond 2,25% 22/6/2057	106.986	0,01
AUD 450.000	Australia Government Bond 2,75% 21/5/2041	234.580	0,02	EUR 2.211.000	Kingdom of Belgium Government Bond 2,75% 22/4/2039	2.210.387	0,22
AUD 1.090.000	Australia Government Bond 3% 21/3/2047	560.754	0,05	EUR 268.000	Kingdom of Belgium Government Bond 3% 22/6/2034	285.819	0,03
AUD 152.000	Australia Government Bond 3,25% 21/6/2039	86.997	0,01	EUR 370.000	Kingdom of Belgium Government Bond 3,75% 22/6/2045*	418.846	0,04
		6.202.088	0,61			17.935.395	1,77
Autriche				Bénin			
EUR 1.086.000	Republic of Austria Government Bond 0% 20/10/2040	679.910	0,07	EUR 100.000	Benin Government International Bond 4,875% 19/1/2032*	81.334	0,01
EUR 808.000	Republic of Austria Government Bond 0,5% 20/2/2029	769.642	0,07	Bermudes			
EUR 530.000	Republic of Austria Government Bond 0,75% 20/3/2051*	320.588	0,03	USD 76.446	Digicel 8% 1/4/2025***	17.965	0,00
EUR 440.000	Republic of Austria Government Bond 0,85% 30/6/2120	187.155	0,02	USD 1.167.000	OHA Credit Funding 12 8,048% 20/7/2036	1.167.279	0,11
EUR 750.000	Republic of Austria Government Bond 0,9% 20/2/2032	684.695	0,07	USD 2.000.000	Symphony CLO 36 7,396% 24/10/2035	2.013.923	0,20
EUR 6.345.000	Republic of Austria Government Bond 1,2% 20/10/2025	6.626.551	0,65			3.199.167	0,31
EUR 90.000	Republic of Austria Government Bond 1,5% 20/2/2047	69.895	0,01	Brésil			
EUR 127.000	Republic of Austria Government Bond 1,5% 2/11/2086*	77.910	0,01	BRL 10.001.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	2.014.936	0,20
EUR 2.170.000	Republic of Austria Government Bond 1,65% 21/10/2024	2.307.989	0,23	BRL 16.134.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	3.297.408	0,32
EUR 635.000	Republic of Austria Government Bond 1,85% 23/5/2049	521.563	0,05			5.312.344	0,52
EUR 1.535.000	Republic of Austria Government Bond 2,9% 23/5/2029	1.662.893	0,16				
EUR 190.000	Republic of Austria Government Bond 3,15% 20/6/2044	203.268	0,02				
EUR 300.000	Republic of Austria Government Bond 3,8% 26/1/2062	362.969	0,04				
EUR 170.000	Republic of Austria Government Bond 4,15% 15/3/2037	202.568	0,01				
		14.677.596	1,44				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Canada				USD 285.497	Clear Creek CLO 6,788% 20/10/2030	284.390	0,03
CAD 1.939.000	Canadian Government Bond 0,25% 1/3/2026	1.293.704	0,13	USD 280.290	Dryden 70 CLO 7,27% 16/1/2032	277.238	0,03
CAD 3.550.000	Canadian Government Bond 1,25% 1/3/2025	2.491.536	0,24	USD 465.235	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 6,833% 15/8/2030	464.098	0,05
CAD 970.000	Canadian Government Bond 1,25% 1/6/2030	613.647	0,06	USD 330.000	Gaci First Investment 4,75% 14/2/2030	320.801	0,03
CAD 420.000	Canadian Government Bond 1,5% 1/9/2024	299.829	0,03	USD 691.000	Galaxy XXII CLO 6,77% 16/4/2034	681.736	0,07
CAD 2.770.000	Canadian Government Bond 1,75% 1/12/2053	1.409.077	0,14	USD 736.668	Generate CLO 2 6,757% 22/1/2031	732.481	0,07
CAD 1.510.000	Canadian Government Bond 2% 1/9/2023	1.116.093	0,11	USD 250.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 6,608% 20/4/2034	248.203	0,02
CAD 60.000	Canadian Government Bond 2% 1/6/2028	40.886	0,00	USD 500.000	Goldentree Loan Management US CLO 10 7,188% 20/7/2034	493.424	0,05
CAD 1.100.000	Canadian Government Bond 2,25% 1/3/2024	801.979	0,08	USD 250.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 7,138% 20/10/2032	249.321	0,02
CAD 2.558.000	Canadian Government Bond 2,75% 1/9/2027	1.801.416	0,18	USD 270.325	Goldentree Loan Opportunities XI 6,642% 18/1/2031	269.753	0,03
CAD 1.777.000	Canadian Government Bond 2,75% 1/12/2048	1.158.164	0,11	USD 476.102	Madison Park Funding XIII 6,532% 19/4/2030	475.005	0,05
CAD 580.000	Canadian Government Bond 3,5% 1/12/2045	428.448	0,04	USD 627.888	Madison Park Funding XXVI 6,831% 29/7/2030	626.258	0,06
CAD 190.000	Canadian Government Bond 5% 1/6/2037	161.813	0,02	USD 232.129	Milos CLO 6,658% 20/10/2030	231.454	0,02
		11.616.592	1,14	USD 500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6,712% 19/10/2031	498.828	0,05
Îles Caïmans				USD 750.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 6,65% 16/10/2033	746.969	0,07
USD 149.526	ABRA Global Finance 11,5% 2/3/2028	126.186	0,01	USD 1.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 7,038% 20/7/2031	992.092	0,10
USD 752.077	ACAS CLO 2015-1 6,462% 18/10/2028	748.880	0,07	USD 1.000.000	OCP CLO 2020-18 6,678% 20/7/2032	990.587	0,10
USD 737.000	AGL CLO 3 8,87% 15/1/2033	728.753	0,07	USD 163.306	OZLM Funding IV 6,857% 22/10/2030	162.811	0,02
USD 1.400.000	AGL CLO 5 6,748% 20/7/2034	1.390.703	0,14	USD 650.000	OZLM VI 7,32% 17/4/2031	644.806	0,06
USD 415.000	AGL Core CLO 2 7,488% 20/4/2032	414.998	0,04	USD 500.000	OZLM XX 7,238% 20/4/2031	489.886	0,05
USD 500.000	AIMCO CLO Series 2017-A 7,688% 20/4/2034	487.725	0,05	USD 500.000	Palmer Square CLO 2018-2 6,67% 16/7/2031	499.044	0,05
USD 1.375.000	Allegro CLO XI 6,972% 19/1/2033	1.367.820	0,13	USD 250.000	Palmer Square CLO 2018-2 7,22% 16/7/2031	248.664	0,02
USD 250.000	Allegro CLO XI 7,432% 19/1/2033	247.472	0,02	USD 250.000	Palmer Square CLO 2020-3 7,226% 15/11/2031	247.978	0,02
USD 278.252	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 6,553% 13/4/2031	276.810	0,03	USD 1.100.000	Pikes Peak CLO 8 6,758% 20/7/2034	1.093.821	0,11
USD 980.000	Anchorage Capital CLO 2018-10 6,77% 15/10/2031	977.074	0,10	USD 415.000	Regatta XXI Funding 7,288% 20/10/2034	411.879	0,04
USD 1.733.000	Apidos CLO XXXII 6,908% 20/1/2033	1.732.220	0,17	USD 261.582	Rockford Tower CLO 2017-3 6,778% 20/10/2030	261.255	0,03
USD 500.000	Apidos CLO XXXIX 6,634% 21/4/2035	495.539	0,05	GBP 100.000	Trafford Centre Finance 6,128% 28/7/2035	90.637	0,01
USD 735.228	ASSURANT CLO 6,628% 20/4/2031	731.877	0,07	USD 201.953	Venture XXVI CLO 6,688% 20/1/2029	201.325	0,02
USD 250.000	Bain Capital Credit CLO 2021-4 6,758% 20/10/2034	248.062	0,02			26.470.728	2,60
USD 321.434	Bean Creek CLO 6,608% 20/4/2031	319.404	0,03	Chili			
USD 500.000	Benefit Street Partners CLO XV 7,272% 18/7/2031	497.503	0,05	USD 200.000	Empresa Nacional del Petroleo 3,75% 5/8/2026	188.147	0,02
USD 500.000	Canyon CLO 2018-1 6,64% 15/7/2031	498.029	0,05	Chine			
USD 496.634	CARLYLE US CLO 2018-1 6,608% 20/4/2031	492.835	0,05	CNY 16.000.000	China Government Bond 1,99% 9/4/2025	2.189.237	0,21
USD 250.000	CIFC Funding 2013-III-R 7,457% 24/4/2031	245.186	0,02	CNY 68.300.000	China Government Bond 2,18% 25/8/2025	9.365.201	0,92
USD 800.000	CIFC Funding 2017-IV 7,157% 24/10/2030	794.242	0,08	CNY 10.000.000	China Government Bond 2,47% 2/9/2024	1.378.250	0,13
USD 465.535	CIFC Funding 2017-V 6,75% 16/11/2030	465.070	0,05	CNY 7.400.000	China Government Bond 2,48% 15/4/2027	1.020.489	0,10
USD 250.000	CIFC Funding 2018-V 6,76% 15/1/2032	249.596	0,02				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
CNY 11.000.000	China Government Bond 2,6% 1/9/2032	1.505.144	0,15	USD 100.000	République dominicaine Dominican Republic International Bond 6,875% 29/1/2026	100.809	0,01
CNY 39.000.000	China Government Bond 2,62% 25/9/2029	5.377.879	0,53	USD 300.000	Égypte Egypt Government International Bond 7,625% 29/5/2032	172.871	0,02
CNY 10.000.000	China Government Bond 2,68% 21/5/2030	1.382.826	0,14	EUR 290.000	Finlande Finland Government Bond 0% 15/9/2023	314.225	0,03
CNY 42.600.000	China Government Bond 2,69% 12/8/2026	5.919.439	0,58	EUR 810.000	Finland Government Bond 0% 15/9/2030	716.719	0,07
CNY 2.300.000	China Government Bond 2,69% 15/8/2032	317.213	0,03	EUR 510.000	Finland Government Bond 0,125% 15/4/2036	377.518	0,04
CNY 15.000.000	China Government Bond 2,74% 4/8/2026	2.086.444	0,20	EUR 380.000	Finland Government Bond 0,125% 15/4/2052	184.164	0,02
CNY 27.800.000	China Government Bond 2,75% 15/6/2029	3.864.144	0,38	EUR 200.000	Finland Government Bond 0,25% 15/9/2040	133.270	0,01
CNY 23.200.000	China Government Bond 2,75% 17/2/2032	3.208.704	0,31	EUR 570.000	Finland Government Bond 0,5% 15/4/2026*	581.136	0,06
CNY 8.000.000	China Government Bond 2,79% 15/12/2029	1.112.022	0,11	EUR 770.000	Finland Government Bond 0,5% 15/9/2028	742.352	0,07
CNY 37.000.000	China Government Bond 2,8% 24/3/2029	5.157.608	0,51	EUR 140.000	Finland Government Bond 0,5% 15/9/2029	131.991	0,01
CNY 23.000.000	China Government Bond 3,01% 13/5/2028	3.244.274	0,32	EUR 741.000	Finland Government Bond 0,5% 15/4/2043	485.908	0,05
CNY 8.000.000	China Government Bond 3,32% 15/4/2052	1.179.816	0,12	EUR 100.000	Finland Government Bond 0,75% 15/4/2031	92.428	0,01
CNY 13.700.000	China Government Bond 3,53% 18/10/2051	2.094.882	0,21	EUR 390.000	Finland Government Bond 2% 15/4/2024*	419.052	0,04
CNY 18.800.000	China Government Bond 3,72% 12/4/2051	2.966.146	0,29	EUR 30.000	Finland Government Bond 2,625% 4/7/2042	29.926	0,00
		53.369.718	5,24			4.208.689	0,41
USD 200.000	Colombie Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	184.572	0,02	EUR 59.412	France FCT Noria 2021 5,142% 25/10/2049	62.844	0,01
USD 218.000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033*	225.621	0,02	EUR 720.000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/2/2025	744.954	0,07
COP 1.529.000.000	Colombian TES 5,75% 3/11/2027	320.534	0,03	EUR 2.702.000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/3/2025*	2.790.467	0,27
COP 6.425.900.000	Colombian TES 6,25% 26/11/2025	1.464.202	0,14	EUR 2.740.000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/2/2026*	2.762.931	0,27
COP 2.496.000.000	Colombian TES 7,5% 26/8/2026	572.734	0,06	EUR 10.875.000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/2/2027*	10.671.996	1,05
USD 420.000	Ecopetrol 6,875% 29/4/2030	390.705	0,04	EUR 1.631.000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/11/2031	1.397.941	0,14
USD 147.000	Ecopetrol 8,875% 13/1/2033	148.837	0,01	EUR 3.505.000	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/5/2025	3.633.873	0,36
		3.307.205	0,32	EUR 1.640.000	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/5/2040	1.136.268	0,11
EUR 100.000	Côte d'Ivoire Ivory Coast Government International Bond 4,875% 30/1/2032	83.932	0,01	EUR 5.289.000	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/6/2044	3.328.882	0,33
CZK 33.460.000	République tchèque Czech Republic Government Bond 2,75% 23/7/2029	1.381.005	0,13	EUR 7.902.000	French Republic Government Bond OAT 0,75% 25/2/2028	7.828.351	0,77
CZK 2.030.000	Czech Republic Government Bond 4,2% 4/12/2036	89.767	0,01	EUR 150.000	French Republic Government Bond OAT 0,75% 25/5/2052	84.853	0,01
CZK 49.560.000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	2.322.543	0,23	EUR 2.434.000	French Republic Government Bond OAT 0,75% 25/5/2053	1.332.658	0,13
		3.793.315	0,37	EUR 3.556.000	French Republic Government Bond OAT 1% 25/11/2025	3.691.526	0,36
DKK 5.160.000	Danemark Denmark Government Bond 0,5% 15/11/2029	659.539	0,07	EUR 5.070.000	French Republic Government Bond OAT 1% 25/5/2027	5.137.655	0,50
DKK 6.000.000	Denmark Government Bond 1,75% 15/11/2025	851.812	0,08	EUR 30.000	French Republic Government Bond OAT 1,25% 25/5/2036	26.000	0,00
DKK 4.210.000	Denmark Government Bond 4,5% 15/11/2039	744.355	0,07	EUR 2.453.382	French Republic Government Bond OAT 1,5% 25/5/2050	1.773.681	0,17
		2.255.706	0,22	EUR 1.500.000	French Republic Government Bond OAT 1,75% 25/6/2039	1.325.532	0,13

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Italie				JPY 265.450.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,4% 20/6/2049	1.381.292	0,14
EUR 200.515	Cassia 2022-1 6,883% 22/5/2034	201.032	0,02	JPY 351.400.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,4% 20/12/2049	1.812.780	0,18
EUR 4.600.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0% 1/4/2026	4.560.105	0,45	JPY 161.400.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,4% 20/3/2050	828.308	0,08
EUR 5.020.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0% 1/8/2026*	4.919.428	0,48	JPY 5.400.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,6% 20/6/2050	29.166	0,00
EUR 290.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,95% 1/8/2030	260.687	0,03	JPY 183.700.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,7% 20/12/2050	1.014.878	0,10
EUR 1.390.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,95% 1/3/2037	1.002.195	0,10	JPY 53.150.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,8% 20/3/2047	316.045	0,03
EUR 2.560.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,1% 1/4/2027	2.554.297	0,25	JPY 50.000.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,8% 20/12/2047	294.872	0,03
EUR 6.630.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,5% 30/4/2045	4.335.575	0,42	JPY 594.950.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,8% 20/3/2048	3.496.673	0,34
EUR 6.290.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,85% 1/7/2025	6.619.597	0,64	JPY 21.450.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,9% 20/9/2048	128.288	0,01
EUR 1.511.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,15% 1/3/2072	937.376	0,09	JPY 1.641.900.000	Japan Government Thirty Year Bond 1% 20/3/2052	9.727.660	0,96
EUR 640.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,45% 1/9/2050*	481.068	0,05	JPY 828.100.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,3% 20/12/2039	4.946.702	0,49
EUR 8.339.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,65% 1/12/2027	8.729.943	0,86	JPY 516.450.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,4% 20/3/2039	3.182.605	0,31
EUR 640.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3% 1/8/2029	669.670	0,07	JPY 1.064.350.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,4% 20/3/2040	6.442.248	0,63
EUR 3.964.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,25% 1/3/2038	3.803.802	0,37	JPY 229.350.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,5% 20/3/2038	1.458.069	0,14
EUR 2.170.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,4% 1/4/2028	2.334.357	0,23	JPY 260.000.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,5% 20/6/2038	1.646.385	0,16
EUR 470.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,45% 1/3/2048*	435.935	0,04	JPY 102.000.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,6% 20/12/2036	669.887	0,07
EUR 595.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,85% 1/9/2049	587.072	0,06	JPY 12.550.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,7% 20/3/2037	83.169	0,01
EUR 2.806.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4% 30/10/2031	3.068.421	0,30	JPY 477.000.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,7% 20/9/2038	3.101.047	0,31
		45.500.560	4,46	JPY 76.550.000	Japan Government Twenty Year Bond 1% 20/12/2035	533.158	0,05
Jamaïque				JPY 1.995.600.000	Japan Government Twenty Year Bond 1,1% 20/9/2042	13.172.082	1,29
USD 41.183	Digicel International Finance/ Digicel international 8% 31/12/2026***	2.445	0,00	JPY 358.050.000	Japan Government Twenty Year Bond 1,4% 20/12/2042	2.485.172	0,24
USD 103.163	Digicel International Finance/ Digicel international 8,75% 25/5/2024	94.657	0,01	JPY 10.000.000	Japan Government Twenty Year Bond 1,8% 20/9/2030	75.129	0,01
USD 62.757	Digicel International Finance/ Digicel international 13% 31/12/2025***	44.871	0,00	JPY 45.150.000	Japan Government Twenty Year Bond 2,1% 20/3/2030	344.265	0,03
		141.973	0,01	JPY 293.400.000	Japan Government Twenty Year Bond 2,2% 20/6/2024	2.044.355	0,20
Japon				JPY 2.476.600.000	Japan Government Two Year Bond 0,005% 1/4/2025	16.952.130	1,66
JPY 494.700.000	Japan Government Five Year Bond 0,005% 20/6/2026	3.379.618	0,33			121.757.889	11,94
JPY 629.800.000	Japan Government Five Year Bond 0,005% 20/9/2026	4.301.454	0,42	Jersey			
JPY 761.050.000	Japan Government Five Year Bond 0,005% 20/3/2027	5.189.961	0,51	USD 1.500.000	AGL CLO 20 8,276% 20/7/2035	1.508.250	0,15
JPY 1.088.150.000	Japan Government Five Year Bond 0,2% 20/3/2028	7.451.136	0,73	Luxembourg			
JPY 541.750.000	Japan Government Forty Year Bond 1% 20/3/2062	2.976.670	0,29	USD 63.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	630	0,00
JPY 331.900.000	Japan Government Ten Year Bond 0,1% 20/9/2028	2.257.104	0,22	USD 27.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	270	0,00
JPY 54.050.000	Japan Government Ten Year Bond 0,1% 20/12/2028	367.038	0,04	EUR 147.000	BL Consumer Credit 2021 5,292% 25/9/2038	157.924	0,02
JPY 77.300.000	Japan Government Ten Year Bond 0,1% 20/6/2029	523.239	0,05	EUR 191.000	BL Consumer Credit 2021 6,492% 25/9/2038	203.935	0,02
JPY 151.700.000	Japan Government Ten Year Bond 0,1% 20/12/2029	1.023.642	0,10	USD 293.000	EIG Pearl 4,387% 30/11/2046	222.220	0,02
JPY 2.668.800.000	Japan Government Ten Year Bond 0,5% 20/12/2032	18.121.662	1,78	EUR 79.995	Germany Compartment Consumer 2020-1 5,371% 14/11/2034	86.736	0,01
				EUR 39.997	Germany Compartment Consumer 2020-1 6,121% 14/11/2034	43.189	0,00
				USD 200.000	Kenbourne Invest 4,7% 22/1/2028	122.000	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 217.000	Kenbourne Invest 6,875% 26/11/2024	182.662	0,02	EUR 680.000	Netherlands Government Bond 0,25% 15/7/2029	640.406	0,06
USD 193.250	MC Brazil Downstream Trading 7,25% 30/6/2031	125.505	0,01	EUR 1.509.000	Netherlands Government Bond 0,5% 15/7/2026	1.531.759	0,15
USD 200.000	Tupy Overseas 4,5% 16/2/2031	161.935	0,02	EUR 990.000	Netherlands Government Bond 0,5% 15/7/2032	884.088	0,09
		1.307.006	0,13	EUR 1.550.000	Netherlands Government Bond 0,5% 15/1/2040	1.160.677	0,11
	Malaisie			EUR 840.000	Netherlands Government Bond 0,75% 15/7/2028	830.305	0,08
MYR 1.000.000	Malaysia Government Bond 4,254% 31/5/2035	220.554	0,02	EUR 160.000	Netherlands Government Bond 2,5% 15/1/2033	169.720	0,02
MYR 4.110.000	Malaysia Government Bond 4,696% 15/10/2042	949.693	0,09	EUR 715.000	Netherlands Government Bond 2,75% 15/1/2047*	759.789	0,08
MYR 950.000	Malaysia Government Bond 4,921% 6/7/2048	224.342	0,02	EUR 280.000	Netherlands Government Bond 3,75% 15/1/2042	338.886	0,03
MYR 3.000.000	Malaysia Government Investment Issue 4,07% 30/9/2026	658.160	0,07	EUR 385.000	Netherlands Government Bond 4% 15/1/2037	467.770	0,05
MYR 4.980.000	Malaysia Government Investment Issue 4,245% 30/9/2030	1.104.496	0,11	EUR 520.000	Netherlands Government Bond 5,5% 15/1/2028	626.058	0,06
		3.157.245	0,31	USD 200.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,4% 1/5/2030	175.462	0,02
						15.274.449	1,50
	Mexique				Nouvelle-Zélande		
USD 200.000	Metalsa Sapi 3,75% 4/5/2031	155.927	0,01	NZD 2.390.000	New Zealand Government Bond 0,5% 15/5/2026	1.258.482	0,12
MXN 27.300.000	Mexican Bonos 7,5% 3/6/2027	1.519.742	0,15	NZD 520.000	New Zealand Government Bond 2% 15/5/2032	246.921	0,02
MXN 55.686.500	Mexican Bonos 7,5% 26/5/2033	2.942.247	0,29	NZD 1.000.000	New Zealand Government Bond 4,5% 15/5/2030	582.081	0,06
MXN 97.346.000	Mexican Bonos 7,75% 29/5/2031	5.295.646	0,52			2.087.484	0,20
MXN 15.000.000	Mexican Bonos 8% 5/9/2024	869.239	0,08		Norvège		
MXN 17.000.000	Mexican Bonos 8% 7/11/2047	883.842	0,09	NOK 4.400.000	Norway Government Bond 1,375% 19/8/2030	351.789	0,03
MXN 70.360.000	Mexican Bonos 8,5% 31/5/2029	4.038.360	0,39	NOK 7.000.000	Norway Government Bond 1,5% 19/2/2026	617.104	0,06
MXN 36.300.400	Mexican Bonos 8,5% 18/11/2038	2.005.627	0,20			968.893	0,09
MXN 12.000.000	Mexican Bonos 10% 5/12/2024	710.123	0,07		Panama		
MXN 255.407.200	Mexico Cetes 0% 30/5/2024	1.404.820	0,14	USD 400.000	Panama Government International Bond 6,4% 14/2/2035	410.764	0,04
MXN 727.242.800	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	3.940.855	0,39				
USD 200.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	165.614	0,01		Philippines		
USD 200.000	Mexico Government International Bond 4,875% 19/5/2033*	189.757	0,02	PHP 20.600.000	Philippine Government Bond 7% 13/7/2038	380.968	0,04
		24.121.799	2,36				
	Maroc				Pologne		
USD 214.000	Morocco Government International Bond 6,5% 8/9/2033	215.428	0,02	USD 222.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375% 22/5/2033	217.837	0,02
	Pays-Bas			PLN 3.460.000	Republic of Poland Government Bond 1,75% 25/4/2032	623.905	0,06
EUR 100.000	Domi 2023-1 5,481% 15/2/2055	107.970	0,01	PLN 3.420.000	Republic of Poland Government Bond 2,25% 25/10/2024	801.381	0,08
EUR 125.000	Dutch Property Finance 2020-2 5,064% 28/1/2058	135.240	0,01	PLN 5.940.000	Republic of Poland Government Bond 2,5% 25/7/2027	1.301.930	0,13
USD 200.000	Embreaer Netherlands Finance 7% 28/7/2030	202.540	0,02	PLN 3.615.000	Republic of Poland Government Bond 4% 25/10/2023*	876.395	0,08
EUR 100.000	Jubilee Place 5,263% 17/1/2059	104.301	0,01	PLN 5.280.000	Republic of Poland Government Bond 7,5% 25/7/2028*	1.397.372	0,14
EUR 3.547.000	Netherlands Government Bond 0% 15/1/2026	3.594.191	0,35			5.218.820	0,51
EUR 1.270.000	Netherlands Government Bond 0% 15/7/2030	1.145.363	0,11		Portugal		
EUR 1.411.000	Netherlands Government Bond 0% 15/7/2031	1.238.004	0,12	EUR 22.136	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos 0,7% 12/2/2024	23.770	0,00
EUR 1.623.000	Netherlands Government Bond 0% 15/1/2052	801.194	0,08				
EUR 350.000	Netherlands Government Bond 0,25% 15/7/2025	360.726	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Roumanie				EUR 87.017	Autonomia Spain 2022 FT 10,642% 29/1/2040	95.815	0,01
EUR 28.000	Romanian Government International Bond 2,124% 16/7/2031	23.143	0,01	EUR 38.864	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5,522% 21/3/2033	41.514	0,00
EUR 199.000	Romanian Government International Bond 2,125% 7/3/2028	190.000	0,02	EUR 5.760.000	Spain Government Bond 0% 31/1/2025	5.955.287	0,58
EUR 23.000	Romanian Government International Bond 2,5% 8/2/2030	20.891	0,00	EUR 4.020.000	Spain Government Bond 0% 31/1/2026	4.037.611	0,40
EUR 22.000	Romanian Government International Bond 2,875% 11/3/2029	21.066	0,00	EUR 11.243.000	Spain Government Bond 0% 31/1/2027	10.946.825	1,07
USD 20.000	Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027	19.656	0,00	EUR 2.785.000	Spain Government Bond 0,25% 30/7/2024	2.929.320	0,29
		274.756	0,03	EUR 2.690.000	Spain Government Bond 0,7% 30/4/2032	2.348.825	0,23
Arabie Saoudite				EUR 1.201.000	Spain Government Bond 0,8% 30/7/2029	1.135.086	0,11
USD 373.000	Saudi Government International Bond 3,45% 2/2/2061	248.371	0,02	EUR 3.520.000	Spain Government Bond 0,85% 30/7/2037	2.630.418	0,26
USD 200.000	Saudi Government International Bond 4,5% 17/4/2030	195.203	0,02	EUR 1.850.000	Spain Government Bond 1% 31/10/2050*	1.029.406	0,10
		443.574	0,04	EUR 2.230.000	Spain Government Bond 1,2% 31/10/2040	1.610.420	0,16
Sénégal				EUR 1.682.000	Spain Government Bond 1,4% 30/7/2028	1.679.444	0,16
EUR 100.000	Senegal Government International Bond 4,75% 13/3/2028	93.724	0,01	EUR 420.000	Spain Government Bond 1,45% 31/10/2071	211.152	0,02
Singapour				EUR 470.000	Spain Government Bond 1,9% 31/10/2052	324.256	0,03
USD 178.250	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027	166.441	0,02	EUR 17.200.000	Spain Government Bond 2,55% 31/10/2032	17.420.004	1,71
USD 150.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	150.311	0,01	EUR 370.000	Spain Government Bond 2,7% 31/10/2048	319.591	0,03
SGD 1.890.000	Singapore Government Bond 2,125% 1/6/2026	1.351.307	0,13	EUR 534.000	Spain Government Bond 3,45% 30/7/2066	506.271	0,05
SGD 290.000	Singapore Government Bond 2,375% 1/7/2039	194.712	0,02	EUR 2.210.000	Spain Government Bond 3,55% 31/10/2033	2.408.051	0,24
SGD 170.000	Singapore Government Bond 2,75% 1/4/2042	119.906	0,01	EUR 64.000	Spain Government Bond 4,9% 30/7/2040	78.223	0,01
SGD 840.000	Singapore Government Bond 2,75% 1/3/2046	591.564	0,06	EUR 975.000	Spain Government Bond 5,15% 31/10/2044*	1.241.004	0,12
SGD 1.140.000	Singapore Government Bond 2,875% 1/9/2030	828.986	0,08			57.140.607	5,60
SGD 200.000	Singapore Government Bond 3% 1/8/2072	148.144	0,02	Suède			
		3.551.371	0,35	SEK 200.000	Sweden Government Bond 0,75% 12/5/2028	16.647	0,00
Afrique du Sud				SEK 4.450.000	Sweden Government Bond 0,75% 12/11/2029	360.926	0,04
ZAR 27.840.586	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	1.329.520	0,13	SEK 8.000.000	Sweden Government Bond 1% 12/11/2026	686.511	0,07
ZAR 3.326.400	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 31/1/2044	128.846	0,01	SEK 1.500.000	Sweden Government Bond 3,5% 30/3/2039	148.202	0,01
ZAR 47.877.159	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040*	1.952.223	0,19			1.212.286	0,12
ZAR 41.733.467	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026*	2.323.987	0,23	Thaïlande			
		5.734.576	0,56	USD 200.000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025	189.400	0,02
Espagne				Ukraine			
EUR 61.054	Autonomia Spain 2021 FT 5,192% 31/1/2039	64.612	0,01	EUR 139.000	Ukraine Government International Bond 4,375% 27/1/2032	35.779	0,00
EUR 61.054	Autonomia Spain 2021 FT 6,292% 31/1/2039	63.986	0,01	USD 256.000	Ukraine Government International Bond 7,375% 25/9/2034	68.160	0,01
EUR 61.054	Autonomia Spain 2021 FT 7,542% 31/1/2039	63.486	0,00	USD 211.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2029	60.979	0,00
				USD 182.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/8/2041	83.720	0,01
						248.638	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Royaume-Uni				GBP 305.000	Turbo Finance 9 6,845% 20/8/2028	387.867	0,04
GBP 100.000	Atlas Funding 2023-1 7,945% 20/1/2061	126.054	0,01	GBP 100.000	Twin Bridges 7,271% 14/6/2055	125.369	0,01
USD 282.642	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	247.582	0,03	GBP 100.000	Twin Bridges 8,271% 14/6/2055	126.706	0,01
GBP 72.338	Azure Finance NO 2 8,195% 20/7/2030	91.893	0,01	GBP 115.000	Twin Bridges 2020-1 7,208% 12/12/2054	145.823	0,02
GBP 115.000	Canada Square Funding 6 6,601% 17/1/2059	139.455	0,01	GBP 125.000	Twin Bridges 2020-1 7,958% 12/12/2054	158.020	0,02
GBP 130.000	Canada Square Funding 6 7,001% 17/1/2059	153.424	0,02	GBP 138.000	Twin Bridges 2021-1 6,558% 12/3/2055	171.225	0,02
EUR 200.000	Channel Link Enterprises Finance 2,706% 30/6/2050	198.362	0,02	GBP 100.000	Twin Bridges 2021-1 7,058% 12/3/2055	123.010	0,01
GBP 115.000	CMF 2020-1 6,196% 16/1/2057	145.580	0,02	GBP 100.000	Twin Bridges 2022-1 6,658% 1/12/2055	117.746	0,01
GBP 100.000	CMF 2020-1 6,446% 16/1/2057	126.387	0,01	GBP 100.000	Twin Bridges 2022-2 6,958% 12/6/2055	126.930	0,01
GBP 200.000	Dowson 2021-2 6,795% 20/10/2028	253.027	0,03	GBP 229.316	Unique Pub Finance 5,659% 30/6/2027	287.084	0,03
GBP 232.000	Finsbury Square 6,247% 16/12/2067	284.583	0,03	GBP 3.934.000	United Kingdom Gilt 0,125% 30/1/2026*	4.480.238	0,44
GBP 100.000	Funding V 6,895% 15/10/2025	126.575	0,01	GBP 290.000	United Kingdom Gilt 0,25% 31/7/2031	268.323	0,03
GBP 100.000	Funding VI 8,295% 15/7/2026	127.551	0,01	GBP 5.000	United Kingdom Gilt 0,375% 22/10/2030	4.817	0,00
GBP 84.646	Greene King Finance 4,064% 15/3/2035	90.527	0,01	GBP 1.185.000	United Kingdom Gilt 0,5% 22/10/2061*	444.183	0,04
GBP 181.000	Harben Finance 6,242% 28/9/2055	218.948	0,02	GBP 1.390.000	United Kingdom Gilt 0,625% 7/6/2025*	1.637.414	0,16
GBP 179.000	Harben Finance 6,592% 28/9/2055	209.142	0,02	GBP 5.800.000	United Kingdom Gilt 0,875% 31/7/2033	5.297.640	0,52
GBP 149.000	Hops Hill No 3 7,332% 21/12/2055	185.192	0,02	GBP 190.000	United Kingdom Gilt 1% 22/4/2024*	234.756	0,02
GBP 100.000	Hops Hill No2 7,445% 27/11/2054	127.789	0,01	GBP 1.829.000	United Kingdom Gilt 1% 31/1/2032	1.777.271	0,18
GBP 100.000	Hops Hill No2 8,045% 27/11/2054	126.410	0,01	GBP 6.040.000	United Kingdom Gilt 1,125% 22/10/2073*†	2.790.488	0,27
GBP 140.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7,208% 12/6/2057	176.269	0,02	GBP 2.750.000	United Kingdom Gilt 1,25% 22/7/2027*	3.085.701	0,30
GBP 100.000	London Cards NO 1 8,945% 15/5/2033	126.392	0,01	GBP 3.290.000	United Kingdom Gilt 1,25% 22/10/2041	2.463.555	0,24
GBP 100.000	Mortimer BTL 2021-1 6,483% 23/6/2053	122.381	0,01	GBP 3.280.000	United Kingdom Gilt 1,25% 31/7/2051	1.989.697	0,20
GBP 100.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-2 10,195% 15/7/2030	128.164	0,01	GBP 2.010.000	United Kingdom Gilt 1,5% 31/7/2053	1.280.103	0,13
GBP 271.000	Newday Partnership Master Issuer 7,986% 15/7/2031	345.251	0,03	GBP 1.620.000	United Kingdom Gilt 1,625% 22/10/2054	1.060.599	0,10
GBP 281.000	Oat Hill NO 3 6,885% 29/5/2046	348.091	0,03	GBP 139.000	United Kingdom Gilt 1,75% 7/9/2037	125.543	0,01
GBP 145.000	Oat Hill NO 3 7,685% 29/5/2046	178.559	0,02	GBP 865.000	United Kingdom Gilt 1,75% 22/1/2049*	629.944	0,06
EUR 24.599	Paragon Mortgages No 12 4,261% 15/11/2038	25.044	0,00	GBP 360.000	United Kingdom Gilt 1,75% 22/7/2057	240.959	0,02
GBP 253.167	Parkmore Point RMBS 2022-1 6,673% 25/7/2045	318.211	0,03	GBP 960.000	United Kingdom Gilt 2% 7/9/2025*	1.149.136	0,11
GBP 136.000	Polaris 2022-1 7,197% 23/10/2059	166.148	0,02	GBP 675.000	United Kingdom Gilt 3,25% 22/1/2044	697.918	0,07
GBP 298.000	Polaris 2022-1 8,597% 23/10/2059	361.479	0,04	GBP 1.616.500	United Kingdom Gilt 3,5% 22/1/2045	1.726.342	0,17
GBP 100.000	Polaris 2023-1 9,547% 23/2/2061	126.423	0,01	GBP 20.000	United Kingdom Gilt 3,5% 22/7/2068	20.902	0,00
GBP 100.000	Residential Mortgage 32 7,225% 20/6/2070	126.328	0,01	GBP 289.000	United Kingdom Gilt 4,25% 7/12/2040	349.971	0,04
GBP 150.000	Sage AR Funding No 1 7,369% 17/11/2030	179.456	0,02	GBP 36.000	United Kingdom Gilt 4,25% 7/12/2055	43.259	0,01
GBP 124.000	Tower Bridge Funding 2021-1 7,014% 21/7/2064	156.538	0,02	GBP 3.760.000	United Kingdom Gilt 4,5% 7/6/2028	4.732.046	0,46
GBP 106.000	Tower Bridge Funding 2021-1 7,314% 21/7/2064	133.129	0,01	GBP 67.000	United Kingdom Gilt 4,5% 7/12/2042	83.460	0,01
GBP 100.000	Tower Bridge Funding 2021-2 7,018% 20/11/2063	120.952	0,01			44.623.456	4,38
GBP 100.000	Tower Bridge Funding 2022-1 6,275% 20/12/2063	122.115	0,01				

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
États-Unis				USD 450.000	Edison International 5,25% 15/11/2028	439.372	0,04
USD 330.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	291.114	0,03	USD 90.000	Elevance Health 4,55% 15/5/2052	77.581	0,01
USD 500.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	452.974	0,04	USD 316.000	Equinix 3,9% 15/4/2032	281.513	0,03
USD 230.000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P 3,779% 5/6/2037	178.325	0,02	USD 100.000	Eversource Energy 5,125% 15/5/2033	96.784	0,01
USD 415.000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P 3,779% 5/6/2037	346.987	0,03	USD 796.000	FirstEnergy Transmission 4,35% 15/1/2025	774.946	0,08
USD 360.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 6,902% 15/9/2034	325.006	0,03	USD 625.000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7,894% 17/8/2037	628.126	0,06
USD 200.000	American Tower 5,55% 15/7/2033	197.810	0,02	USD 200.000	General Motors 5,4% 15/10/2029	193.107	0,02
USD 170.000	Amgen 5,75% 2/3/2063	168.029	0,01	USD 666.000	General Motors 6,125% 1/10/2025	668.744	0,06
USD 150.000	Aon / Aon Global 5,35% 28/2/2033	149.715	0,02	USD 237.509	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2,31% 20/10/2048	183.424	0,02
USD 730.000	AREIT 2022-CRE7 7,556% 17/6/2039	730.287	0,07	USD 1.129.254	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-3 4,95% 20/7/2049	1.026.515	0,10
USD 200.000	Azul Investments 5,875% 26/10/2024	184.000	0,02	USD 347.214	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP1 3,843% 25/1/2035	296.554	0,03
USD 200.000	Azul Secured Finance 11,93% 28/8/2028	199.171	0,02	USD 248.205	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP3 3,816% 25/9/2035	226.820	0,02
USD 240.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3,716% 14/4/2033	205.352	0,02	USD 460.000	HMH Trust 2017-NSS 3,062% 5/7/2031	428.636	0,04
USD 450.613	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 7,058% 15/9/2034	446.439	0,04	USD 3.479.424	IXIS Real Estate Capital Trust 2006-HE2 5,949% 25/8/2036	1.026.795	0,10
USD 1.600.000	Bank of America 5,202% 25/4/2029	1.575.864	0,16	USD 495.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4,359% 17/3/2049	405.650	0,04
USD 623.185	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5,834% 25/4/2036	561.232	0,05	USD 184.000	JPMorgan Chase 5,35% 1/6/2034	182.161	0,02
USD 800.000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6,479% 15/3/2037	676.948	0,07	USD 177.799	Mastr Asset Backed Trust 2005- WF1 7,154% 25/6/2035	178.628	0,02
USD 410.000	BDS 2022-FL12 7,45% 19/8/2038	409.406	0,04	USD 547.000	MF1 2022-FL10 7,949% 17/9/2037	548.997	0,05
USD 264.000	Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust 4,295% 10/4/2051	215.173	0,02	USD 114.000	Moody's 3,75% 25/2/2052	87.317	0,01
USD 350.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	292.599	0,03	USD 3.046.000	Morgan Stanley 5,424% 21/7/2034	2.997.314	0,29
USD 320.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	276.505	0,03	USD 5.268.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	5.231.361	0,51
USD 384.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3,85% 1/4/2061	229.869	0,02	USD 1.874.000	Morgan Stanley Bank 5,479% 16/7/2025	1.874.611	0,18
USD 226.549	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-FX1 7,275% 25/10/2036	131.989	0,01	USD 306.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 4,668% 15/10/2048	282.074	0,03
USD 287.403	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A5 6% 25/5/2037	251.239	0,02	USD 132.260	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 4,281% 15/6/2050	104.886	0,01
USD 100.000	Comcast 2,887% 1/11/2051	64.211	0,00	USD 923.286	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 4,62% 15/7/2051	789.038	0,08
USD 440.000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 4,514% 10/9/2047	413.721	0,04	USD 253.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	171.459	0,02
USD 1.131.519	COMM 2015-CCRE27 Mortgage Trust 4,486% 10/10/2048	1.026.786	0,10	USD 367.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	316.800	0,03
USD 201.000	CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust 3,708% 15/11/2048	161.913	0,02	USD 164.784	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4,38% 21/1/2053	153.188	0,02
USD 235.096	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-25 5,569% 25/6/2037	216.307	0,02	USD 690.000	MSSG Trust 2017-237P 3,397% 13/9/2039	598.211	0,06
USD 705.969	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4 5,809% 25/8/2047	570.189	0,06	USD 120.000	Nasdaq 5,55% 15/2/2034	119.675	0,01
				USD 116.949	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D 3,01% 15/12/2059	108.240	0,01
				USD 258.002	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 6,149% 25/10/2035	248.185	0,02
				USD 595.644	Newcastle Mortgage Trust 2007-1 5,659% 25/4/2037	577.080	0,06

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.400.000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3,14% 14/10/2036	1.284.912	0,13	USD 277.693	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2,84% 25/1/2041	267.275	0,03
USD 130.901	OneMain Financial Issuance Trust 2020-A 3,84% 14/5/2032	130.582	0,01	USD 1.363.000	Sprint 7,625% 15/2/2025	1.391.507	0,14
USD 100.000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2,22% 16/6/2036	83.745	0,01	USD 693.210	Tricon American Homes 2019-SFR1 Trust 2,75% 17/3/2038	645.754	0,06
USD 100.000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2,47% 16/6/2036	80.729	0,01	USD 1.850.000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 3,487% 15/8/2050	1.686.342	0,17
USD 758.000	Oracle 3,95% 25/3/2051	553.790	0,06	USD 68.200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	62.995	0,01
USD 200.000	Periama 5,95% 19/4/2026	190.752	0,02	USD 2.200.000	United States Treasury Note/ Bond 1,125% 29/2/2028	1.912.797	0,19
USD 130.000	Prologis 5,125% 15/1/2034	128.013	0,01	USD 6.890.000	United States Treasury Note/ Bond 1,125% 15/8/2040	4.232.505	0,42
USD 1.196.301	RASC Series 2006-EMX9 Trust 5,909% 25/11/2036	949.063	0,09	USD 8.489.900	United States Treasury Note/ Bond 1,75% 15/8/2041	5.708.794	0,56
USD 331.700	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 7,782% 25/6/2037	332.337	0,03	USD 4.870.000	United States Treasury Note/ Bond 1,875% 15/2/2041	3.381.606	0,33
USD 4.000.000	RR 1 6,72% 15/7/2035	3.975.263	0,39	USD 1.770.000	United States Treasury Note/ Bond 2% 15/11/2041	1.238.931	0,12
USD 234.000	Ryder System 5,65% 1/3/2028	234.465	0,02	USD 728.400	United States Treasury Note/ Bond 2% 15/2/2050	466.774	0,05
USD 205.000	Sasol Financing USA 5,875% 27/3/2024	202.818	0,02	USD 260.000	United States Treasury Note/ Bond 2,25% 15/8/2049	177.003	0,02
USD 200.000	Sasol Financing USA 8,75% 3/5/2029	196.250	0,02	USD 3.050.000	United States Treasury Note/ Bond 2,25% 15/2/2052	2.059.465	0,20
USD 230.400	Sesac Finance 5,216% 25/7/2049	218.383	0,02	USD 15.510.000	United States Treasury Note/ Bond 2,75% 15/8/2032	13.915.378	1,37
USD 129.716	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-A 5,952% 15/6/2033	128.035	0,01	USD 908.000	United States Treasury Note/ Bond 2,75% 15/11/2047	687.775	0,07
USD 781.235	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 5,842% 15/6/2039	750.510	0,07	USD 1.398.000	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/5/2032	1.269.941	0,12
USD 231.778	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 5,752% 15/12/2039	222.487	0,02	USD 688.100	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/11/2046	535.508	0,05
USD 769.250	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 5,822% 15/12/2039	739.423	0,07	USD 30.000	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/5/2049	23.279	0,00
USD 370.787	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 5,792% 16/12/2041	358.995	0,04	USD 770.000	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/5/2045	617.008	0,06
USD 618.661	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10,175% 15/10/2041	654.712	0,06	USD 2.360.000	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/2/2047	1.877.030	0,18
USD 345.000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 3,5% 15/9/2043	330.786	0,03	USD 3.760.000	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/2/2048*	2.985.381	0,29
USD 165.650	SMB Private Education Loan Trust 2019-A 3,44% 15/7/2036	158.065	0,02	USD 3.380.000	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/8/2048	2.683.139	0,26
USD 560.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3% 15/8/2045	476.374	0,05	USD 4.009.000	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/8/2052*	3.197.647	0,31
USD 690.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2,5% 15/9/2054	550.401	0,05	USD 26.810.000	United States Treasury Note/ Bond 3,125% 31/8/2027	25.555.376	2,51
USD 1.271.480	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 6,639% 16/2/2055	1.266.561	0,12	USD 1.670.000	United States Treasury Note/ Bond 3,125% 15/5/2048	1.356.973	0,13
USD 1.112.436	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4,48% 16/5/2050	1.067.150	0,11	USD 770.000	United States Treasury Note/ Bond 3,375% 15/11/2048	654.680	0,06
USD 196.000	SoFi Professional Loan Program 2017-D 3,61% 25/9/2040	175.907	0,02	USD 8.940.000	United States Treasury Note/ Bond 4,125% 15/11/2032	8.931.270	0,88
USD 315.000	SoFi Professional Loan Program 2017-E 4,16% 26/11/2040	285.866	0,03	USD 132.610.000	United States Treasury Note/ Bond 4,25% 31/5/2025	130.897.984	12,84
				USD 70.000	UnitedHealth 5,05% 15/4/2053	66.943	0,01
				USD 500.000	Verizon Communications 5,05% 9/5/2033	484.880	0,05
				USD 625.128	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR11 Trust 5,39% 25/9/2046	497.390	0,05
				USD 1.126.442	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR13 Trust 5,31% 25/10/2046	943.239	0,09
				USD 931.422	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 5,228% 25/6/2047	717.497	0,07

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.172.065	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-AR8 Trust 5,28% 25/10/2046	976.009	0,10
USD 142.765	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-1 3,919% 20/6/2044	132.573	0,01
		270.237.974	26,50
Total des obligations		981.438.621	96,26
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		981.438.621	96,26
Total du portefeuille		981.438.621	96,27
Autres éléments de l'actif net		38.005.798	3,73
Total de l'actif net (USD)		1.019.444.419	100,00

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	190.000	NZD	208.888	ANZ	20/9/2023	(1.095)
AUD	250.000	USD	172.202	Morgan Stanley	20/9/2023	(10.168)
BRL	14.523.528	USD	2.929.822	Citigroup	14/9/2023	13.225
BRL	17.141.975	USD	3.471.489	Citigroup	20/9/2023	(1.237)
BRL	4.969.917	USD	1.010.000	Barclays	20/9/2023	(3.881)
BRL	19.000.000	USD	3.941.398	BNY Mellon	20/9/2023	(95.004)
BRL	1.423.200	USD	300.000	Barclays	5/9/2023	(11.180)
BRL	9.565.000	USD	1.929.190	Goldman Sachs	20/9/2023	7.166
BRL	1.512.000	USD	309.000	Barclays	14/9/2023	(2.609)
BRL	1.473.006	USD	300.000	HSBC Bank	3/10/2023	(2.435)
BRL	9.565.000	USD	1.953.157	Citigroup	5/9/2023	(12.063)
CAD	170.000	USD	129.241	Bank of America	20/9/2023	(3.550)
CLP	398.067.000	USD	459.131	BNP Paribas	14/9/2023	6.207
CLP	264.306.000	USD	306.193	JP Morgan	14/9/2023	2.779
CLP	215.350.000	USD	250.000	Barclays	15/9/2023	1.711
CLP	264.306.000	USD	305.415	Toronto-Dominion	14/9/2023	3.558
CNH	5.940.000	USD	840.788	Citigroup	14/9/2023	(23.910)
CNH	11.720.000	USD	1.626.916	JP Morgan	14/9/2023	(15.164)
CNH	1.089.483	USD	150.000	Goldman Sachs	18/9/2023	(142)
COP	4.507.882.000	USD	1.106.731	Standard Chartered Bank	14/9/2023	(12.588)
COP	3.159.004.000	USD	719.755	BNP Paribas	17/5/2024	7.729
COP	1.249.611.000	USD	303.672	Bank of America	14/9/2023	(369)
COP	615.600.000	USD	150.000	Barclays	18/9/2023	(782)
COP	2.570.398.000	USD	618.330	Toronto-Dominion	29/9/2023	2.423
COP	1.283.025.000	USD	310.810	Citigroup	14/9/2023	603
CZK	61.465.000	USD	2.782.153	Morgan Stanley	20/9/2023	(11.835)
CZK	14.662.051	USD	663.826	Toronto-Dominion	14/9/2023	(2.829)
CZK	47.132.258	USD	2.131.441	BNP Paribas	20/9/2023	(7.121)
CZK	1.742.860	USD	80.014	Morgan Stanley	6/9/2023	(1.417)
CZK	47.639.842	USD	2.186.608	Morgan Stanley	14/9/2023	(38.899)
CZK	6.855.269	USD	310.000	Barclays	18/9/2023	(998)
EUR	2.980.000	USD	3.233.671	Toronto-Dominion	20/9/2023	1.971
EUR	1.960.000	GBP	1.682.748	UBS	20/9/2023	(5.151)
EUR	1.880.000	USD	2.051.209	Credit Agricole	20/9/2023	(9.932)
EUR	5.540.000	USD	6.078.139	RBS	20/9/2023	(62.885)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	8.980.000	USD	9.889.557	JP Morgan	20/9/2023	(139.199)
EUR	4.530.000	GBP	3.914.985	JP Morgan	20/9/2023	(44.581)
EUR	4.530.000	GBP	3.900.899	Bank of America	20/9/2023	(26.724)
EUR	2.690.000	USD	2.943.524	HSBC Bank	20/9/2023	(22.760)
EUR	2.080.000	USD	2.274.406	Deutsche Bank	20/9/2023	(15.971)
EUR	390.000	USD	426.761	Société Générale	20/9/2023	(3.305)
EUR	770.000	GBP	659.936	HSBC Bank	20/9/2023	(574)
EUR	43.264	NOK	500.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(2)
EUR	10.530.000	USD	11.559.318	Citigroup	20/9/2023	(125.993)
EUR	35.798	NOK	400.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.288
EUR	1.493.000	USD	1.658.730	Citibank	14/9/2023	(38.123)
EUR	4.000.000	USD	4.397.820	Barclays	20/9/2023	(54.676)
EUR	120.000	USD	132.750	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.456)
EUR	185.486	AUD	305.000	State Street	5/9/2023	3.681
EUR	1.792.209	USD	1.979.705	Morgan Stanley	5/9/2023	(35.163)
EUR	2.320.000	GBP	2.000.680	Morgan Stanley	20/9/2023	(17.323)
EUR	38.042	HUF	15.000.000	Société Générale	20/9/2023	(1.347)
EUR	80.000	USD	88.016	Bank of America	20/9/2023	(1.153)
EUR	41.273	HUF	16.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(681)
EUR	2.350.000	GBP	2.009.343	Citigroup	20/9/2023	4.268
EUR	8.770.000	USD	9.501.102	RBS	5/9/2023	14.328
GBP	680.000	USD	859.216	Barclays	20/9/2023	2.849
GBP	2.657.088	EUR	3.090.000	HSBC Bank	20/9/2023	13.425
GBP	130.000	USD	166.786	Deutsche Bank	20/9/2023	(1.979)
GBP	664.121	EUR	770.000	Deutsche Bank	20/9/2023	5.880
GBP	2.438.565	EUR	2.800.000	Morgan Stanley	20/9/2023	51.271
GBP	30.000	USD	38.659	Morgan Stanley	20/9/2023	(626)
GBP	435.562	EUR	507.380	Morgan Stanley	5/9/2023	1.636
GBP	150.000	USD	192.620	HSBC Bank	20/9/2023	(2.458)
GBP	1.000.389	EUR	1.160.000	Bank of America	20/9/2023	8.723
HUF	672.594.783	USD	1.907.583	JP Morgan	14/9/2023	7.286
HUF	45.000.000	EUR	115.621	Deutsche Bank	20/9/2023	2.415
HUF	15.000.000	EUR	38.447	JP Morgan	20/9/2023	906
HUF	16.000.000	EUR	40.227	BNP Paribas	20/9/2023	1.817
HUF	88.928.318	USD	250.000	Deutsche Bank	18/9/2023	2.968
HUF	161.946.000	USD	458.654	Citigroup	14/9/2023	2.405
IDR	6.870.000.000	USD	460.209	Bank of America	20/9/2023	(9.219)
IDR	45.177.330.000	USD	3.031.470	State Street	20/9/2023	(65.749)
IDR	24.825.044.488	USD	1.671.047	UBS	20/9/2023	(41.377)
IDR	24.344.975.000	USD	1.624.081	JP Morgan	14/9/2023	(25.784)
IDR	5.890.000.000	USD	391.466	Barclays	20/9/2023	(4.810)
IDR	3.059.000.000	USD	200.000	Barclays	18/9/2023	818
IDR	4.097.635.360	USD	267.156	Barclays	26/9/2023	1.815
IDR	16.195.242.627	USD	1.056.372	Citigroup	20/9/2023	6.784
IDR	17.161.013.392	USD	1.121.708	HSBC Bank	14/9/2023	4.947
INR	117.380.000	USD	1.416.110	Barclays	20/9/2023	1.705
INR	310.323.000	USD	3.746.218	Citigroup	14/9/2023	2.179
INR	63.088.000	USD	763.870	BNP Paribas	14/9/2023	(1.828)
JPY	357.119.408	USD	2.581.344	Bank of America	20/9/2023	(131.648)
JPY	284.000.000	USD	2.068.089	Credit Agricole	20/9/2023	(119.962)
JPY	23.000.000	USD	165.296	BNP Paribas	20/9/2023	(7.526)
JPY	55.560.000	USD	389.298	JP Morgan	20/9/2023	(8.179)
JPY	12.940.000	USD	91.021	Morgan Stanley	20/9/2023	(2.258)
JPY	6.000.000	USD	43.840	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(2.683)
JPY	3.000.000	USD	21.844	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(1.265)
JPY	863.000.000	USD	6.222.412	Morgan Stanley	5/9/2023	(316.774)
JPY	207.990.000	USD	1.471.614	BNP Paribas	5/9/2023	(48.308)
JPY	44.000.000	USD	307.593	HSBC Bank	20/9/2023	(5.770)
JPY	590.100.000	USD	4.168.214	Standard Chartered Bank	5/9/2023	(130.072)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
JPY	22.000.000	USD	151.272	Barclays	20/9/2023	(361)
KRW	1.055.840.000	USD	809.467	Citigroup	14/9/2023	(10.570)
MXN	132.652.987	USD	7.536.370	Barclays	20/9/2023	368.089
MXN	27.700.000	USD	1.577.278	BNY Mellon	20/9/2023	73.295
MXN	123.379.367	USD	7.022.789	Royal Bank of Canada	20/9/2023	329.077
MXN	20.705.000	USD	1.204.606	State Street	20/9/2023	29.153
MXN	6.012.745	USD	350.000	JP Morgan	18/9/2023	8.409
MYR	2.970.851	USD	657.996	Barclays	14/9/2023	(17.267)
MYR	961.380	USD	210.000	Barclays	18/9/2023	(2.597)
NOK	8.282.258	USD	753.229	Deutsche Bank	14/9/2023	24.776
NOK	7.940.000	USD	755.307	HSBC Bank	20/9/2023	(9.311)
NOK	788.000	USD	75.606	Toronto-Dominion	20/9/2023	(1.570)
NOK	1.700.000	USD	162.279	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.557)
NOK	200.000	USD	19.075	Citigroup	20/9/2023	(284)
NOK	4.120.000	USD	396.355	Morgan Stanley	20/9/2023	(9.265)
NOK	1.020.000	USD	98.971	JP Morgan	20/9/2023	(3.139)
NOK	550.000	USD	52.337	Bank of America	20/9/2023	(662)
NOK	900.000	EUR	76.526	Goldman Sachs	20/9/2023	1.468
NOK	650.000	USD	61.607	Deutsche Bank	20/9/2023	(537)
NOK	160.000	USD	14.915	UBS	20/9/2023	118
NOK	180.000	USD	17.843	Barclays	20/9/2023	(931)
NOK	230.000	USD	22.660	Société Générale	20/9/2023	(1.051)
NOK	760.000	USD	71.894	BNP Paribas	20/9/2023	(490)
NZD	209.818	AUD	190.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.649
NZD	200.000	USD	124.706	Morgan Stanley	20/9/2023	(5.752)
NZD	210.000	USD	130.536	Toronto-Dominion	20/9/2023	(5.634)
NZD	60.000	USD	36.839	HSBC Bank	20/9/2023	(1.153)
PLN	4.785.000	USD	1.148.170	Bank of America	14/9/2023	12.854
SEK	20.785.000	USD	1.949.294	HSBC Bank	20/9/2023	(42.520)
SEK	1.070.000	USD	102.985	Citigroup	20/9/2023	(4.826)
SEK	3.970.000	USD	374.135	Morgan Stanley	20/9/2023	(9.934)
SEK	1.080.000	USD	101.748	Barclays	20/9/2023	(2.672)
SEK	1.020.000	USD	94.954	Deutsche Bank	20/9/2023	(1.380)
SEK	480.000	USD	44.058	Bank of America	20/9/2023	(23)
SEK	210.000	USD	19.406	Société Générale	20/9/2023	(141)
SEK	820.000	USD	78.210	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.984)
SEK	200.000	USD	18.529	BNY Mellon	20/9/2023	(181)
SEK	290.000	USD	27.332	Toronto-Dominion	20/9/2023	(728)
SEK	450.000	USD	43.995	State Street	20/9/2023	(2.712)
SEK	1.630.000	USD	151.331	BNP Paribas	20/9/2023	(1.799)
SEK	280.000	USD	25.654	RBS	20/9/2023	33
SGD	1.059.985	USD	789.448	JP Morgan	14/9/2023	(4.913)
THB	60.870.340	USD	1.762.314	HSBC Bank	14/9/2023	(22.306)
THB	55.732.000	USD	1.616.303	Citigroup	14/9/2023	(23.175)
THB	35.200.000	USD	1.015.507	Citigroup	20/9/2023	(8.698)
THB	10.925.950	USD	310.000	Goldman Sachs	18/9/2023	2.448
TWD	7.900.000	USD	254.215	Citigroup	20/9/2023	(6.109)
USD	454.165	CZK	10.019.423	Barclays	6/9/2023	2.324
USD	1.772.225	IDR	26.441.158.000	Citigroup	20/9/2023	36.463
USD	259.621	TWD	7.900.000	Barclays	20/9/2023	11.514
USD	1.451.784	IDR	21.610.964.448	UBS	14/9/2023	32.980
USD	992.807	CZK	22.015.236	Deutsche Bank	14/9/2023	312
USD	6.036.546	MXN	106.727.643	JP Morgan	14/9/2023	(329.720)
USD	2.574.773	ZAR	49.691.114	State Street	14/9/2023	(67.450)
USD	2.694.775	MXN	47.089.051	Citigroup	14/9/2023	(114.071)
USD	1.263.373	IDR	19.139.991.300	Citigroup	14/9/2023	6.794
USD	3.236.871	MYR	14.857.110	Morgan Stanley	20/9/2023	31.222
USD	2.358.253	MXN	41.410.000	JP Morgan	20/9/2023	(109.264)
USD	735.463	IDR	11.086.331.000	Barclays	20/9/2023	7.687

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	254.990	GBP	200.000	JP Morgan	20/9/2023	1.442
USD	8.858.340	BRL	43.686.082	Citigroup	20/9/2023	14.453
USD	2.593.609	JPY	357.120.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	143.908
USD	641.093	INR	52.949.153	Barclays	20/9/2023	1.528
USD	2.234.593	NOK	23.680.000	HSBC Bank	20/9/2023	9.757
USD	6.407.468	IDR	95.189.222.662	UBS	20/9/2023	158.655
USD	1.758.876	ZAR	32.955.000	HSBC Bank	20/9/2023	7.488
USD	212.252	KRW	267.870.259	State Street	20/9/2023	9.558
USD	12.419	EUR	11.444	State Street	20/9/2023	(7)
USD	749.940	SEK	7.960.000	Bank of America	20/9/2023	19.707
USD	65.606	EUR	60.129	Citigroup	14/9/2023	338
USD	188.009	SEK	2.020.000	BNP Paribas	20/9/2023	2.701
USD	108.073	SEK	1.168.000	Goldman Sachs	20/9/2023	923
USD	423.847	NOK	4.370.000	Morgan Stanley	20/9/2023	13.267
USD	89.077	GBP	70.000	Morgan Stanley	20/9/2023	335
USD	2.263.799	JPY	313.841.517	BNP Paribas	20/9/2023	110.971
USD	18.960	SEK	200.000	Deutsche Bank	20/9/2023	612
USD	380.256	SEK	4.000.000	Morgan Stanley	20/9/2023	13.304
USD	3.152.103	EUR	2.880.000	HSBC Bank	20/9/2023	25.040
USD	171.660	AUD	250.000	Bank of America	20/9/2023	9.627
USD	3.515.000	BRL	17.281.544	Barclays	20/9/2023	16.494
USD	115.833	EUR	105.460	Deutsche Bank	22/9/2023	1.315
USD	182.448	EUR	166.095	Bank of America	22/9/2023	2.088
USD	1.000.000	MXN	17.439.393	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(39.170)
USD	1.122.817	GBP	880.000	HSBC Bank	20/9/2023	7.204
USD	22.425	NOK	240.000	RBS	20/9/2023	(124)
USD	1.689.508	EUR	1.540.000	JP Morgan	20/9/2023	17.397
USD	99.427	NOK	1.050.000	JP Morgan	20/9/2023	775
USD	5.020.000	CNY	35.892.856	BNY Mellon	20/9/2023	67.177
USD	38.338	GBP	30.000	Bank of America	20/9/2023	305
USD	1.280.614	EUR	1.160.000	BNP Paribas	20/9/2023	21.102
USD	84.324	SEK	890.000	JP Morgan	20/9/2023	2.676
USD	768.888	IDR	11.514.094.363	Citigroup	26/9/2023	13.098
USD	3.210.739	ZAR	61.019.178	Citigroup	14/9/2023	(33.830)
USD	20.577	SEK	220.000	Citigroup	20/9/2023	394
USD	667.145	EUR	610.000	Société Générale	20/9/2023	4.816
USD	93.032	NOK	980.000	Barclays	20/9/2023	958
USD	834.767	COP	3.631.861.199	Bank of America	20/12/2023	(25.125)
USD	785.200	SGD	1.059.985	Citigroup	14/9/2023	666
USD	2.510.000	BRL	12.370.133	HSBC Bank	20/9/2023	5.768
USD	6.629.470	EUR	5.956.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	162.528
USD	3.459.701	INR	284.595.000	Barclays	14/9/2023	22.072
USD	238.479	NOK	2.460.000	Goldman Sachs	20/9/2023	7.353
USD	12.977.008	EUR	11.840.000	Standard Chartered Bank	20/9/2023	121.303
USD	1.492.436	EUR	1.360.000	Deutsche Bank	20/9/2023	15.768
USD	1.034.343	EUR	944.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	9.361
USD	48.385	NOK	490.000	BNY Mellon	20/9/2023	2.348
USD	30.033	NOK	320.000	Bank of America	20/9/2023	(33)
USD	371.377	IDR	5.576.961.000	HSBC Bank	20/9/2023	5.270
USD	1.017.051	SGD	1.370.000	Morgan Stanley	20/9/2023	2.786
USD	191.588	GBP	150.000	Barclays	20/9/2023	1.427
USD	237.980	INR	19.600.000	Goldman Sachs	20/9/2023	1.234
USD	150.000	TWD	4.666.500	BNP Paribas	11/10/2023	3.331
USD	2.235.152	EUR	2.060.000	Barclays	20/9/2023	(1.567)
USD	1.683.867	EUR	1.540.000	Citigroup	20/9/2023	11.756
USD	16.562	SEK	180.000	Barclays	20/9/2023	49
USD	2.490.000	MXN	43.259.617	Barclays	20/9/2023	(87.732)
USD	431.417	JPY	62.000.000	HSBC Bank	20/9/2023	6.122
USD	170.696	JPY	23.880.000	JP Morgan	20/9/2023	6.889

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	21.290	JPY	3.000.000	Morgan Stanley	20/9/2023	711
USD	87.332	NOK	900.000	Deutsche Bank	20/9/2023	2.773
USD	374.614	PHP	20.600.000	Deutsche Bank	20/9/2023	10.934
USD	36.184	JPY	5.000.000	Barclays	20/9/2023	1.886
USD	127.385	NZD	200.000	Morgan Stanley	20/9/2023	8.430
USD	54.061	SEK	560.000	State Street	20/9/2023	2.686
USD	16.626	SEK	170.000	BNY Mellon	20/9/2023	1.030
USD	128.983	CAD	170.000	Morgan Stanley	20/9/2023	3.293
USD	822.206	NOK	8.282.258	Barclays	14/9/2023	44.200
USD	2.702.301	CZK	59.349.236	Barclays	14/9/2023	26.707
USD	973.993	HUF	341.025.000	Bank of America	14/9/2023	3.098
USD	3.319.175	BRL	16.212.594	BNY Mellon	14/9/2023	33.857
USD	13.504	SEK	140.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	661
USD	9.682.690	EUR	8.770.000	Morgan Stanley	5/9/2023	167.260
USD	5.016.904	ZAR	89.351.897	UBS	5/9/2023	262.034
USD	1.022.883	GBP	796.961	BNY Mellon	5/9/2023	12.611
USD	37.192	NZD	60.000	HSBC Bank	20/9/2023	1.505
USD	5.456.709	CNH	38.900.000	UBS	5/9/2023	109.612
USD	1.199.965	NOK	12.140.000	Morgan Stanley	5/9/2023	59.902
USD	379.448.710	EUR	343.608.614	BNP Paribas	5/9/2023	6.634.133
USD	10.467.269	AUD	15.586.661	State Street	5/9/2023	370.611
USD	45.764.047	GBP	35.575.520	Standard Chartered Bank	5/9/2023	666.533
USD	3.604.817	PLN	14.420.000	Goldman Sachs	5/9/2023	104.228
USD	138.501.909	JPY	19.587.915.086	Deutsche Bank	5/9/2023	4.458.881
USD	1.528.936	SEK	16.010.000	Morgan Stanley	5/9/2023	61.301
USD	2.394.609	NZD	3.860.000	State Street	5/9/2023	98.869
USD	6.296.916	CZK	136.632.259	Goldman Sachs	5/9/2023	135.036
USD	740.799	JPY	104.772.313	UBS	5/9/2023	23.826
USD	2.182.861	ILS	8.050.000	UBS	5/9/2023	71.425
USD	3.899.148	SGD	5.176.275	UBS	5/9/2023	69.558
USD	110.467	EUR	100.000	HSBC Bank	5/9/2023	1.967
USD	13.429.761	CAD	17.739.452	State Street	5/9/2023	316.981
USD	46.107	CHF	40.000	RBS	5/9/2023	813
USD	3.074.731	DKK	20.732.655	Morgan Stanley	5/9/2023	56.005
USD	50.101.745	CNH	357.158.331	Société Générale	5/9/2023	1.007.652
USD	77.960	TRY	2.140.000	BNP Paribas	5/9/2023	(2.324)
USD	21.298.076	MXN	358.673.231	Goldman Sachs	5/9/2023	(130.096)
USD	1.229.775	PLN	4.930.000	State Street	5/9/2023	32.971
USD	396.160	GBP	310.000	RBS	5/9/2023	3.187
USD	405.503	EUR	370.000	Deutsche Bank	5/9/2023	4.053
USD	1.070.626	PLN	4.376.000	JP Morgan	14/9/2023	8.841
USD	799.059	BRL	3.905.000	Goldman Sachs	14/9/2023	7.750
USD	21.543	NOK	220.000	UBS	20/9/2023	874
USD	3.009.561	CZK	66.745.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.266
USD	3.010.000	MXN	52.583.385	BNP Paribas	20/9/2023	(123.312)
USD	1.384.951	HUF	504.545.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(49.699)
USD	506.194	PLN	2.065.000	Deutsche Bank	20/9/2023	5.312
USD	191.461	EUR	174.197	UBS	7/11/2023	1.867
USD	623.596	ZAR	11.763.212	State Street	7/11/2023	1.164
USD	1.506.617	MXN	25.719.482	Barclays	14/9/2023	(27.541)
USD	91.600	COP	387.467.416	Citigroup	20/12/2023	(138)
USD	24.960	CZK	553.668	UBS	6/9/2023	(8)
USD	305.903	JPY	44.000.000	Bank of America	20/9/2023	4.080
USD	1.394.735	CNH	10.112.000	Citigroup	14/9/2023	4.118
USD	139.746	JPY	20.130.000	Barclays	5/9/2023	1.994
USD	23.420	SEK	250.000	UBS	20/9/2023	486
USD	100.000	CLP	85.330.000	Morgan Stanley	15/9/2023	262
USD	815.250	EUR	745.000	Barclays	14/9/2023	6.574
USD	801.641	COP	3.244.640.000	Citigroup	14/9/2023	14.109

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	812.891	CNH	5.910.000	RBS	14/9/2023	139
USD	458.346	GBP	360.000	State Street	5/9/2023	1.990
USD	755.923	COP	3.159.004.000	BNP Paribas	17/10/2023	(3.142)
USD	251.476	EUR	230.000	Deutsche Bank	18/9/2023	1.769
USD	150.000	MXN	2.586.813	JP Morgan	18/9/2023	(4.195)
USD	150.000	COP	618.370.500	Citigroup	18/9/2023	111
USD	150.000	CNY	1.096.301	BNY Mellon	18/9/2023	(1.165)
USD	17.172	NOK	180.000	Citigroup	20/9/2023	261
USD	461.263	THB	16.343.000	BNP Paribas	14/9/2023	(5.910)
USD	51.037	GBP	40.000	HSBC Bank	5/9/2023	331
USD	108.858	EUR	100.000	Standard Chartered Bank	18/9/2023	290
USD	110.000	THB	3.901.920	Goldman Sachs	18/9/2023	(1.583)
USD	89.013	GBP	70.000	Toronto-Dominion	5/9/2023	277
USD	203.702	GBP	160.000	Royal Bank of Canada	18/9/2023	865
USD	1.778.949	ZAR	33.805.000	Goldman Sachs	5/9/2023	(19.987)
USD	1.933.761	BRL	9.565.000	Goldman Sachs	5/9/2023	(7.333)
USD	511.767	JPY	74.360.000	HSBC Bank	5/9/2023	2.910
USD	1.108.066	EUR	1.020.000	Royal Bank of Canada	5/9/2023	1.369
USD	3.317.393	MXN	56.081.525	Barclays	28/9/2023	(19.716)
USD	44.988	NOK	480.000	BNP Paribas	20/9/2023	(110)
USD	622.369	BRL	3.046.000	Citigroup	14/9/2023	5.128
USD	300.000	BRL	1.466.475	HSBC Bank	5/9/2023	2.398
USD	25.482	SEK	280.000	RBS	20/9/2023	(205)
USD	9.507.776	EUR	8.770.000	RBS	20/9/2023	(14.566)
USD	1.541.340	COP	6.321.498.403	BNY Mellon	14/9/2023	7.000
ZAR	52.910.000	USD	2.764.368	BNY Mellon	20/9/2023	47.526
ZAR	24.996.896	USD	1.334.082	Morgan Stanley	20/9/2023	(5.626)
ZAR	29.905.000	USD	1.591.313	Barclays	20/9/2023	(2.016)
ZAR	14.625.000	USD	811.887	HSBC Bank	14/9/2023	(34.232)
ZAR	26.498.000	USD	1.404.358	Citigroup	14/9/2023	4.620
ZAR	11.763.211	USD	612.047	Morgan Stanley	7/11/2023	10.385
ZAR	33.805.000	USD	1.776.481	Goldman Sachs	20/9/2023	20.080
Plus-value nette non réalisée						14.029.462
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	599.058.832	USD	656.967.923	BNY Mellon	15/9/2023	(6.672.109)
USD	30.458.224	EUR	27.927.097	BNY Mellon	15/9/2023	142.635
Moins-value nette non réalisée						(6.529.474)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	763.584	USD	971.607	BNY Mellon	15/9/2023	(3.602)
USD	13.898	GBP	10.933	BNY Mellon	15/9/2023	39
Moins-value nette non réalisée						(3.563)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	34.773	USD	4.455	BNY Mellon	15/9/2023	(19)
USD	73	HKD	566	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(19)
Catégorie d'Actions couverte en NOK						
NOK	73.217.351	USD	7.130.053	BNY Mellon	15/9/2023	(251.976)
USD	110.341	NOK	1.158.622	BNY Mellon	15/9/2023	1.500
Moins-value nette non réalisée						(250.476)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	1.988.244.267	USD	186.073.733	BNY Mellon	15/9/2023	(3.719.350)
USD	15.198.336	SEK	166.275.785	BNY Mellon	15/9/2023	(51.664)
Moins-value nette non réalisée						(3.771.014)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.962.217.988)						3.474.916

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
7	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	1.010.084	7.410
1	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	125.756	879
(15)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	15.081.594	12.521
89	AUD	Australian 10 Year Bond	Septembre 2023	6.707.648	4.977
3	KRW	Korean 10 Year Bond	Septembre 2023	248.716	(2.519)
47	KRW	Korean 3 Year Bond	Septembre 2023	3.682.482	(7.044)
(197)	EUR	3 Month EURIBOR	Septembre 2023	51.397.734	(5.872)
(559)	EUR	Euro BOBL	Décembre 2023	71.183.072	(248.659)
30	EUR	Euro BUXL	Décembre 2023	4.342.602	60.540
15	EUR	Euro Schatz	Décembre 2023	1.715.868	2.522
118	EUR	Euro-BTP	Décembre 2023	14.780.317	92.860
129	EUR	Euro-OAT	Décembre 2023	17.812.446	110.545
61	CAD	Canadian 10 Year Bond	Décembre 2023	5.379.657	98.296
52	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	6.321.250	84.088
423	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	46.906.734	350.301
(74)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	8.582.844	(96.614)
99	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	12.817.406	175.678
34	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	4.108.733	44.254
53	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	10.794.609	30.783
1.634	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	174.518.859	634.949
32	EUR	Short-Term Euro-BTP	Décembre 2023	3.645.763	9.721
12	GBP	3 Month SONIA	Mars 2024	3.585.421	8.294
14	USD	3 Month SOFR	Juin 2024	3.316.775	(2.975)
189	EUR	3 Month EURIBOR	Septembre 2024	49.528.387	(154.374)
205	USD	3 Month SOFR	Septembre 2024	48.720.812	38.125
(14)	USD	3 Month SOFR	Mars 2025	3.352.300	12.690
Total				569.667.869	1.261.376

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 212.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(2.896)	(1.489)
CDS	USD 210.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(2.869)	(1.475)
CDS	USD 210.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(2.869)	(1.475)
CDS	USD 214.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(2.897)	(1.504)
CDS	USD 300.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(4.061)	(2.108)
CDS	USD 129.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(1.747)	(906)
CDS	USD 726.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(35.272)	31.921
CDS	USD 726.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(28.962)	19.506
CDS	USD 682.183	Fund receives default protection on Mexican; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(12.359)	(311)
CDS	USD (28.337.000)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	133.499	838.439
CDS	EUR 1.266.300	Fund receives default protection on ITRAXX.XO.39.V1; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	(8.350)	(56.744)
CDS	USD 627.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(6.105)	27.568
CDS	USD 306.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(3.876)	13.454
CDS	USD (205.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.BBB-; and receives Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	(3.421)	(43.520)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD (25.000.000)	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.40; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	48.605	394.809
IFS	EUR 980.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,56%	BNP Paribas	15/6/2028	902	902
IFS	EUR 670.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,46%	BNP Paribas	15/7/2028	2.865	2.865
IFS	EUR 420.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,435%	BNP Paribas	15/5/2033	4.459	4.596
IFS	EUR 820.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,555%	BNP Paribas	15/6/2033	(671)	(671)
IFS	EUR 830.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,505%	BNP Paribas	15/7/2033	(3.516)	(3.516)
IFS	EUR 230.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,5737%	Bank of America	15/5/2038	(1.126)	(1.126)
IFS	EUR 425.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,60125%	Bank of America	15/5/2043	(4.864)	(4.565)
IRS	BRL 17.442.000	Fund receives Fixed 9,98%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2026	(8.775)	(8.775)
IRS	BRL 76.835.870	Fund receives Fixed 10,66%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2025	(1.714)	(1.714)
IRS	BRL 1.472.858	Fund receives Fixed 11,5625%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	7.868	7.868
IRS	BRL 1.823.847	Fund receives Fixed 11,82%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	12.149	12.149
IRS	USD 11.590.000	Fund receives Fixed 3,69%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Barclays	20/8/2027	31.519	31.519
IRS	USD 3.630.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,8215%	Barclays	22/8/2043	(34.605)	(34.605)
IRS	MXN 24.288.000	Fund receives Fixed 11,7%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	12/2/2024	1.445	1.445
IRS	MXN 14.484.000	Fund receives Fixed 11,72%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	14/2/2024	952	952
IRS	KRW 4.615.810.000	Fund receives Fixed 3,865%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	3/7/2024	1.677	1.677
IRS	USD 54.990.000	Fund receives Fixed 5,2703%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	BNP Paribas	18/7/2024	(85.676)	(85.676)
IRS	MXN 386.730.000	Fund receives Fixed 11,15%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	16/8/2024	(11.007)	(11.007)
IRS	MXN 46.382.504	Fund receives Fixed 9,785%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	4/2/2025	(28.171)	(28.171)
IRS	AUD 3.380.000	Fund receives Floating AUD BBSW 3 Month; and pays Fixed 3,8025%	BNP Paribas	9/2/2025	12.300	12.300
IRS	NZD 3.760.000	Fund receives Fixed 4,94%; and pays Floating NZD BBR 3 Month	BNP Paribas	10/2/2025	(19.034)	(19.034)
IRS	ZAR 25.291.000	Fund receives Fixed 7,2%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	BNP Paribas	20/3/2025	(8.151)	(8.151)
IRS	CZK 63.783.000	Fund receives Floating CZK-PRIBOR-PRBO 3 Month; and pays Fixed 4,615%	BNP Paribas	19/6/2025	(11.060)	(11.060)
IRS	GBP 21.900.000	Fund receives Fixed 5,45%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	BNP Paribas	1/8/2025	34.749	36.915
IRS	GBP 1.400.000	Fund receives Fixed 5,795%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	BNP Paribas	17/8/2025	8.929	8.929
IRS	GBP 21.460.000	Fund receives Fixed 5,55505%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	BNP Paribas	19/8/2025	100.206	70.056
IRS	GBP 4.490.000	Fund receives Fixed 5,4%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	BNP Paribas	23/8/2025	7.371	7.192
IRS	GBP 540.000	Fund receives Fixed 3,7%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	BNP Paribas	31/3/2026	(6.447)	(6.447)
IRS	JPY 811.140.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,266%	BNP Paribas	7/7/2026	9.431	9.431
IRS	JPY 183.000.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,2925%	BNP Paribas	7/7/2026	1.798	1.798
IRS	JPY 182.980.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,3205%	BNP Paribas	7/7/2026	1.450	1.450
IRS	KRW 1.385.322.200	Fund receives Fixed 3,1875%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2026	(13.699)	(13.699)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	KRW 1.023.933.800	Fund receives Fixed 3,19%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2026	(10.071)	(10.071)
IRS	KRW 561.241.870	Fund receives Fixed 3,33%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2026	(3.840)	(3.840)
IRS	KRW 2.566.795.000	Fund receives Fixed 3,376%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2026	(15.038)	(15.038)
IRS	KRW 561.326.065	Fund receives Fixed 3,38%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2026	(3.241)	(3.241)
IRS	KRW 561.326.065	Fund receives Fixed 3,3825%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2026	(3.211)	(3.211)
IRS	KRW 2.566.795.000	Fund receives Fixed 3,384%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2026	(14.599)	(14.599)
IRS	KRW 2.566.410.000	Fund receives Fixed 3,389%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	BNP Paribas	20/9/2026	(14.322)	(14.322)
IRS	BRL 220.000	Fund receives Fixed 9,94%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(467)	(467)
IRS	MXN 10.494.000	Fund receives Fixed 8,42%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	20/1/2028	(13.738)	(13.738)
IRS	GBP 26.680.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 3,41%	BNP Paribas	23/2/2028	186.731	186.409
IRS	MXN 6.762.000	Fund receives Fixed 8,35%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	28/4/2028	(9.567)	(9.567)
IRS	CZK 14.349.000	Fund receives Fixed 4,321%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	BNP Paribas	20/9/2028	2.570	2.570
IRS	PLN 1.668.500	Fund receives Floating PLN WIBOR 6 Month; and pays Fixed 5,7005%	BNP Paribas	20/9/2028	(21.171)	(21.171)
IRS	AUD 790.000	Fund receives Fixed 4,15%; and pays Floating AUD BBSW 6 Month	BNP Paribas	9/2/2033	(8.861)	(8.861)
IRS	NZD 870.000	Fund receives Floating NZD BBR 3 Month; and pays Fixed 4,2525%	BNP Paribas	10/2/2033	17.963	17.963
IRS	MXN 2.648.000	Fund receives Fixed 8,5%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	28/7/2033	(2.812)	(2.812)
IRS	EUR 960.000	Fund receives Fixed 2,78%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	1/8/2033	(921)	(472)
IRS	MXN 1.320.000	Fund receives Fixed 8,58%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	1/8/2033	(984)	(984)
IRS	EUR 11.500.000	Fund receives Fixed 2,8333%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	3/8/2033	21.023	21.023
IRS	EUR 11.600.000	Fund receives Fixed 2,8493%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	4/8/2033	29.229	29.229
IRS	EUR 510.000	Fund receives Fixed 3%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	17/8/2033	4.926	4.580
IRS	EUR 5.950.000	Fund receives Fixed 2,8643%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	28/8/2033	17.129	17.129
IRS	EUR 70.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,668%	BNP Paribas	4/2/2048	2.446	2.446
IRS	EUR 450.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,8133%	BNP Paribas	15/8/2048	2.299	2.299
IRS	EUR 30.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,761%	BNP Paribas	4/10/2052	(131)	(131)
IRS	EUR 110.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,2705%	BNP Paribas	4/3/2053	10.869	10.869
IRS	COP 2.527.760.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 11,895%	Bank of America	19/10/2024	(1.909)	(1.909)
IRS	BRL 3.694.759	Fund receives Fixed 11,865%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	8.910	8.910
IRS	BRL 1.874.000	Fund receives Fixed 10,04%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(3.601)	(3.601)
IRS	BRL 430.000	Fund receives Fixed 10,11%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(507)	(507)
IRS	BRL 872.000	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 10,1%	Bank of America	4/1/2027	640	640
IRS	BRL 60.112.495	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(2.045)	(2.045)
IRS	BRL 20.012.428	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(681)	(681)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	COP 4.874.415.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 12,37%	Citibank	18/4/2024	939	939
IRS	BRL 3.406.000	Fund receives Fixed 11,745%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	21.272	21.272
IRS	BRL 1.149.275	Fund receives Fixed 11,76%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	7.284	7.284
IRS	BRL 3.073.364	Fund receives Fixed 11,8%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	20.141	20.141
IRS	NZD 3.910.000	Fund receives Fixed 4,697%; and pays Floating NZD BBR 3 Month	Bank of America	20/12/2024	(19.411)	(19.411)
IRS	AUD 3.385.000	Fund receives Floating AUD BBSW 3 Month; and pays Fixed 4,0425%	Bank of America	20/12/2024	4.023	4.023
IRS	JPY 150.555.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,23%	Bank of America	11/1/2025	(2.469)	(2.469)
IRS	JPY 588.200.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,235%	Bank of America	19/1/2025	(9.954)	(9.954)
IRS	GBP 2.880.000	Fund receives Fixed 5,65%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	22/8/2025	12.700	12.700
IRS	JPY 612.000.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,1045%	Bank of America	20/9/2025	3.470	3.470
IRS	GBP 1.070.000	Fund receives Fixed 3,6%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/3/2026	(14.127)	(14.183)
IRS	GBP 680.000	Fund receives Fixed 3,75343%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/3/2026	(9.472)	(7.854)
IRS	JPY 183.000.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,324%	Bank of America	7/7/2026	1.406	1.406
IRS	JPY 548.900.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,33%	Bank of America	7/7/2026	3.994	3.994
IRS	JPY 279.979.800	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,331%	Bank of America	7/7/2026	2.018	2.018
IRS	JPY 269.000.200	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,364%	Bank of America	7/7/2026	1.336	1.336
IRS	GBP 4.630.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 4,75%	Bank of America	26/8/2026	(8.074)	(7.533)
IRS	ZAR 47.818.749	Fund receives Floating ZAR JIBAR 3 Month; and pays Fixed 8,22%	Credit Suisse	20/9/2026	(21.422)	(21.422)
IRS	GBP 2.720.000	Fund receives Fixed 3,44723%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	16/3/2027	(31.088)	(27.231)
IRS	GBP 2.810.000	Fund receives Fixed 3,175%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/1/2028	(27.123)	(27.050)
IRS	EUR 684.000	Fund receives Fixed 3,1518%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	21/7/2028	(244)	(244)
IRS	GBP 290.000	Fund receives Fixed 4,86823%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	4/8/2028	685	958
IRS	GBP 300.000	Fund receives Fixed 4,8733%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	4/8/2028	1.074	1.074
IRS	GBP 310.000	Fund receives Fixed 4,77918%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	11/8/2028	1.105	(413)
IRS	GBP 300.000	Fund receives Fixed 4,9008%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	11/8/2028	1.580	1.580
IRS	EUR 802.000	Fund receives Fixed 2,4425%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	14/7/2032	(15.276)	(15.276)
IRS	EUR 1.010.000	Fund receives Fixed 2,962%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	31/3/2033	(8.008)	(7.875)
IRS	CHF 680.000	Fund receives Floating CHF SARON 1 Day; and pays Fixed 1,912%	Bank of America	31/3/2033	(13.709)	(13.033)
IRS	GBP 220.000	Fund receives Fixed 3,4329%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/6/2033	(3.266)	(3.266)
IRS	GBP 280.000	Fund receives Fixed 3,6589%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/6/2033	(1.283)	(1.283)
IRS	EUR 2.340.000	Fund receives Fixed 3,0313%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	23/8/2033	24.050	24.050
IRS	USD 2.740.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,8642%	Bank of America	23/8/2033	(31.464)	(31.464)
IRS	EUR 1.610.000	Fund receives Fixed 2,87515%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	25/8/2033	5.653	5.469

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	USD 1.890.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,71334%	Bank of America	25/8/2033	(12.462)	(11.014)
IRS	EUR 590.000	Fund receives Fixed 2,85708%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	28/8/2033	1.642	1.511
IRS	USD 670.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,828%	Bank of America	26/8/2035	(13.379)	(13.254)
IRS	CHF 280.000	Fund receives Fixed 1,8565%; and pays Floating CHF SARON 1 Day	Bank of America	31/3/2053	10.600	9.864
IRS	EUR 310.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,508%	Bank of America	31/3/2053	14.634	14.528
IRS	COP 5.140.795.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 10,2%	Goldman Sachs	28/2/2025	453	453
IRS	BRL 18.204.000	Fund receives Fixed 10,1075%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	2/1/2026	145	145
IRS	BRL 13.494.584	Fund receives Fixed 10,005%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(27.866)	(27.866)
IRS	BRL 393.000	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 10,105%	Goldman Sachs	4/1/2027	311	311
IRS	BRL 74.378.892	Fund receives Fixed 10,42%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2025	(45.126)	(45.126)
IRS	BRL 1.199.921	Fund receives Fixed 11,775%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2026	7.702	7.702
IRS	BRL 440.000	Fund receives Fixed 10,425%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	2	2
IRS	BRL 2.110.157	Fund receives Fixed 11,83%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2026	14.170	14.170
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 417.795.502)					88.158	1.215.970

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
80.000	Put	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1,018	12/9/2023	(3.372)	-
670.000	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 150	1/5/2024	1.230	5.129
780.000	Call	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,125	20/12/2023	(4.133)	3.549
6.390.000	Call	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7,82	10/11/2023	1.701	9.209
1.150.000	Call	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,133	12/10/2023	(8.217)	409
1.060.000	Put	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6,9	18/10/2023	(4.923)	48
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 624.417)						(17.714)	18.344

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(6.390.000)	Call	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7,85	10/11/2023	547	(1.051)
(1.060.000)	Put	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6,775	18/10/2023	1.964	(2)
(780.000)	Call	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,125	20/12/2023	9.398	(3.549)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 277.661)						11.909	(4.602)

Global Government Bond Fund suite

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD 6.000.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 22/11/2024; and pays 3,84% Fixed semi-annually from 22/5/2024	Barclays	20/11/2023	33.235	91.048
USD 6.000.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 28/11/2024; and pays 3,96% Fixed semi-annually from 28/5/2024	Barclays	24/11/2023	9.837	69.483
JPY 174.345.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	8.288	18.208
JPY 108.093.900	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	5.178	11.289
JPY 66.251.100	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	3.179	6.919
EUR 16.600.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/10/2024; and pays 3,37% Fixed annually from 29/7/2025	Citibank	25/7/2024	(8.069)	69.771
EUR 14.480.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 9/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024	JP Morgan	7/8/2024	(3.968)	43.779
EUR 14.920.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 29/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024	JP Morgan	27/8/2024	(4.391)	48.819
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 27.939.562)				43.289	359.316

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (20.000.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,35% Fixed semi-annually from 22/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 22/11/2024	Barclays	20/11/2023	(93.372)	(149.025)
USD (20.000.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,48% Fixed semi-annually from 28/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 28/11/2024	Barclays	24/11/2023	(55.751)	(115.398)
USD (10.690.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,9% Fixed semi-annually from 5/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 5/12/2024	Citibank	1/12/2023	(80.940)	(148.287)
JPY (174.345.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 24/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 24/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(2.938)	(8.449)
JPY (108.093.900)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 22/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(1.844)	(5.238)
JPY (66.251.100)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 22/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(1.133)	(3.211)
USD (10.690.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 19/1/2025; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 19/7/2024	Citibank	17/1/2024	56.021	(4.912)
USD (18.780.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,495% Fixed semi-annually from 29/1/2025; and pays Floating USD SOFR annually from 29/7/2025	JP Morgan	25/7/2024	638	(77.017)
EUR (14.480.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 9/8/2024	JP Morgan	7/8/2024	1.807	(14.268)
EUR (14.920.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 29/8/2025	JP Morgan	27/8/2024	(1.654)	(16.488)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 46.581.934)				(179.166)	(542.293)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Government Bond Fund suite

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
United States			
USD 7.525.915	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	6.485.819	0,64
USD 22.713.459	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	20.292.344	1,99
USD 27.830.000	Fannie Mae or Freddie Mac 6% TBA	27.895.586	2,74
<hr/>			
Total TBA (USD Exposition sous-jacente - USD 54.673.749)		54.673.749	5,37

Global High Yield Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 2.432.000	Valaris 8,375% 30/4/2030	2.481.613	0,15
				USD 602.000	Weatherford International 6,5% 15/9/2028	603.543	0,03
				USD 1.525.000	Weatherford International 8,625% 30/4/2030	1.564.331	0,09
						22.023.430	1,32
ACTIONS ORDINAIRES				Brésil			
France				USD 2.803.000	Banco do Brasil 4,875% 11/1/2029*	2.642.613	0,16
186.861	Constellium*	3.316.783	0,20	USD 1.855.000	Banco do Brasil 6,25% 18/4/2030*	1.842.293	0,11
Luxembourg						4.484.906	0,27
99.822	ADLER	55.342	0,00	Îles Vierges britanniques			
Panama				USD 911.000	Arcos Dorados 5,875% 4/4/2027	891.692	0,05
39.738	Carnival	628.258	0,04	USD 200.000	CAS Capital No 1 4% 12/7/2026	163.215	0,01
États-Unis				USD 200.000	Celestial Miles 5,75% 31/1/2024	187.983	0,01
5.742	Block*	333.036	0,02	USD 3.903.000	Central American Bottling / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 5,25% 27/4/2029	3.572.943	0,21
12.395	Catalent	619.626	0,04	USD 200.000	Champion Path 4,5% 27/1/2026	177.217	0,01
61.468	Element Solutions*	1.278.534	0,07	USD 275.000	ENN Clean Energy International Investment 3,375% 12/5/2026	252.741	0,02
64.765	Informatica	1.353.589	0,08	USD 300.000	Fortune Star BVI 5% 18/5/2026	198.780	0,01
1.460	Nine Energy Service	6.585	0,00	EUR 580.000	Global Switch 2,25% 31/5/2027	585.767	0,04
2.770	Twilio	175.147	0,01	USD 1.700.000	Gold Fields Orogen BVI 5,125% 15/5/2024	1.684.555	0,10
20.830	Uber Technologies	974.427	0,06	USD 325.000	Gold Fields Orogen BVI 6,125% 15/5/2029	321.913	0,02
		4.740.944	0,28	USD 200.000	Sino-Ocean Land Treasure IV 4,75% 14/1/2030	16.000	0,00
Total des actions ordinaires		8.741.327	0,52	USD 243.240	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033	237.254	0,01
OBLIGATIONS				USD 200.000	Studio City 7% 15/2/2027*	189.871	0,01
Argentine				USD 350.000	Studio City Finance 5% 15/1/2029	263.324	0,02
USD 377.923	Aeropuertos Argentina 2000 8,5% 1/8/2031	369.183	0,02	USD 250.000	Studio City Finance 6% 15/7/2025	235.521	0,01
USD 4.280.000	YPF 6,95% 21/7/2027	3.619.575	0,22			8.978.776	0,53
USD 1.066.000	YPF 8,5% 28/7/2025	1.003.372	0,06	Canada			
USD 1.460.747	YPF 9% 12/2/2026	1.440.720	0,09	USD 183.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,875% 15/1/2028	166.688	0,01
USD 220.000	YPF 9% 30/6/2029	202.386	0,01	USD 390.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	332.171	0,02
		6.635.236	0,40	USD 927.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4,375% 15/1/2028	851.859	0,06
Australie				USD 445.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 5,75% 15/4/2025	442.251	0,03
USD 393.000	Macquarie Bank 6,798% 18/1/2033	397.755	0,02	USD 1.154.000	Air Canada 3,875% 15/8/2026	1.067.392	0,06
Autriche				USD 338.000	ATS 4,125% 15/12/2028	300.780	0,02
EUR 1.200.000	ams-OSRAM 0% 5/3/2025	1.093.280	0,07	USD 488.000	Baytex Energy 8,5% 30/4/2030	495.166	0,03
USD 3.413.000	Klabin Austria 3,2% 12/1/2031*	2.735.451	0,16	USD 2.073.000	Bombardier 6% 15/2/2028	1.937.829	0,12
USD 300.000	Klabin Austria 5,75% 3/4/2029	291.839	0,02	USD 2.962.000	Bombardier 7,125% 15/6/2026	2.914.777	0,18
		4.120.570	0,25	USD 536.000	Bombardier 7,45% 1/5/2034	610.504	0,04
Belgique				USD 109.000	Bombardier 7,5% 15/3/2025	109.099	0,01
EUR 457.000	Azelis Finance 5,75% 15/3/2028*	505.441	0,03	USD 2.031.000	Bombardier 7,5% 1/2/2029	1.995.809	0,12
EUR 600.000	KBC 4,75% 5/3/2024	642.993	0,04	USD 2.547.000	Bombardier 7,875% 15/4/2027	2.543.396	0,15
		1.148.434	0,07	USD 909.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 4,875% 15/2/2030	749.658	0,04
Bermudes				USD 319.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	266.127	0,02
USD 449.000	Aircastle 6,5% 18/7/2028	445.559	0,03	USD 2.071.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,25% 15/5/2026	2.052.219	0,12
USD 8.484.000	Carnival Bermuda 10,375% 1/5/2028	9.243.360	0,56	USD 10.370.000	Clarios Global / Clarios US Finance 8,5% 15/5/2027	10.493.724	0,63
USD 225.000	China Oil & Gas 4,7% 30/6/2026	188.449	0,01	USD 868.000	Enerflex 9% 15/10/2027	863.668	0,05
USD 41.171	Digicel 8,75% 25/5/2024	37.712	0,00	USD 829.000	ERO Copper 6,5% 15/2/2030	724.641	0,05
USD 927.000	Geopark 5,5% 17/1/2027*	792.200	0,05	USD 1.135.000	First Quantum Minerals 8,625% 1/6/2031	1.156.317	0,07
USD 509.000	Nabors Industries 7,25% 15/1/2026	490.385	0,03				
USD 1.168.000	Nabors Industries 7,5% 15/1/2028	1.076.022	0,06				
USD 1.630.000	NCL 5,875% 15/3/2026	1.537.734	0,09				
USD 179.000	NCL 7,75% 15/2/2029	170.945	0,01				
USD 462.000	NCL 8,375% 1/2/2028	476.314	0,03				
USD 833.000	NCL Finance 6,125% 15/3/2028	747.443	0,05				
USD 1.250.000	OHA Credit Funding 11 8,92% 19/7/2033	1.229.378	0,07				
USD 715.000	Seadrill Finance 8,375% 1/8/2030	733.318	0,05				
USD 200.000	Seadrill Finance 8,375% 1/8/2030	205.124	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Chine				EUR 4.000.000	Electricite de France 3,375% 15/6/2030	3.380.689	0,20
USD 750.000	Industrial & Commercial Bank of China 3,2% 24/9/2026	690.593	0,04	EUR 700.000	Electricite de France 4% 4/7/2024	738.766	0,05
Colombie				EUR 2.400.000	Electricite de France 5,375% 29/1/2025*	2.542.027	0,15
USD 598.000	Banco Davivienda 6,65% 22/4/2031	441.922	0,03	GBP 2.600.000	Electricite de France 6% 29/1/2026	3.060.234	0,18
USD 2.055.000	Banco de Bogota 4,375% 3/8/2027*	1.898.902	0,11	EUR 800.000	Electricite de France 7,5% 6/9/2028*	892.693	0,05
USD 2.626.000	Bancolombia 6,909% 18/10/2027	2.538.856	0,15	USD 300.000	Electricite de France 9,125% 15/3/2033	313.260	0,02
USD 5.050.000	Ecopetrol 4,625% 2/11/2031*	3.974.252	0,24	EUR 1.334.000	Elior 3,75% 15/7/2026	1.153.164	0,07
USD 3.024.000	Ecopetrol 5,375% 26/6/2026*	2.926.824	0,17	EUR 1.500.000	Eutelsat 1,5% 13/10/2028*	1.243.403	0,08
USD 2.649.000	Ecopetrol 5,875% 2/11/2051*	1.779.121	0,11	EUR 400.000	Eutelsat 2% 2/10/2025*	398.498	0,02
USD 1.240.000	Ecopetrol 6,875% 29/4/2030	1.153.510	0,07	EUR 1.359.000	Forvia 2,75% 15/2/2027	1.346.164	0,08
USD 1.146.000	Promigas / Gases del Pacifico 3,75% 16/10/2029	966.651	0,06	EUR 790.000	Forvia 3,75% 15/6/2028	784.925	0,05
		15.680.038	0,94	EUR 1.504.000	Forvia 7,25% 15/6/2026	1.698.692	0,10
Chypre				EUR 2.013.000	Goldstory 5,375% 1/3/2026*	2.111.421	0,13
EUR 825.000	Bank of Cyprus 2,5% 24/6/2027	798.590	0,05	EUR 400.000	iliad 2,375% 17/6/2026	405.049	0,02
Finlande				EUR 2.600.000	iliad 5,375% 14/6/2027	2.799.786	0,17
EUR 979.000	Ahlstrom 3 Oy 3,625% 4/2/2028	890.463	0,05	EUR 700.000	iliad 5,625% 15/2/2030*	739.716	0,05
USD 360.000	Ahlstrom 3 Oy 4,875% 4/2/2028	300.329	0,02	EUR 640.000	Iliad 5,625% 15/10/2028*	655.460	0,04
EUR 186.000	Citycon 4,496% 24/11/2024	136.921	0,01	USD 4.600.000	Iliad 6,5% 15/10/2026	4.386.883	0,26
EUR 625.000	Finnair 4,25% 19/5/2025	643.756	0,04	USD 1.091.000	Iliad 7% 15/10/2028	1.016.439	0,06
EUR 1.827.000	SBB Treasury 0,75% 14/12/2028	1.112.110	0,07	EUR 1.232.000	La Financiere Atalian 5,125% 15/5/2025	918.307	0,06
EUR 1.200.000	SBB Treasury 1,125% 26/11/2029	722.769	0,04	GBP 206.000	La Financiere Atalian 6,625% 15/5/2025	180.184	0,01
		3.806.348	0,23	EUR 1.945.000	Loxam 6,375% 15/5/2028*	2.095.627	0,13
France				EUR 790.000	Novafives 5% 15/6/2025	810.386	0,05
EUR 500.000	Accor 2,625% 30/1/2025	511.595	0,03	EUR 1.641.000	Paprec 3,5% 1/7/2028	1.630.931	0,10
EUR 1.600.000	Accor 4,375% 31/1/2024	1.717.382	0,10	EUR 1.028.000	Paprec 4% 31/3/2025	1.099.843	0,07
EUR 500.000	Air France-KLM 1,875% 16/1/2025*	516.336	0,03	EUR 1.388.000	Picard Groupe 3,875% 1/7/2026	1.390.943	0,08
EUR 900.000	Air France-KLM 8,125% 31/5/2028	1.018.423	0,06	EUR 6.500.000	RCI Banque 2,625% 18/2/2030*	6.637.831	0,40
EUR 1.917.000	Altice France 2,125% 15/2/2025	1.929.051	0,12	EUR 200.000	Renault 1,25% 24/6/2025	204.306	0,01
EUR 385.000	Altice France 2,5% 15/1/2025	387.370	0,02	USD 1.896.000	Societe Generale 7,875% 18/12/2023	1.891.048	0,11
EUR 570.000	Altice France 3,375% 15/1/2028	433.589	0,03	EUR 500.000	Societe Generale 7,875% 18/1/2029	530.262	0,03
USD 895.000	Altice France 5,125% 15/1/2029	641.743	0,04	USD 779.000	Societe Generale 8% 29/9/2025	766.202	0,05
USD 616.000	Altice France 5,125% 15/7/2029	438.163	0,03	EUR 1.025.000	Tereos Finance Groupe I 7,25% 15/4/2028	1.154.494	0,07
USD 2.826.000	Altice France 5,5% 15/10/2029	2.041.299	0,12	EUR 1.585.000	Vallourec 8,5% 30/6/2026	1.719.449	0,10
EUR 794.000	Altice France 5,875% 1/2/2027	698.254	0,04			79.161.225	4,76
USD 2.352.000	Altice France 8,125% 1/2/2027	1.989.868	0,12	Allemagne			
EUR 2.100.000	Atos 0% 6/11/2024	1.921.077	0,12	EUR 2.900.000	Bayer 4,5% 25/3/2082	2.992.133	0,18
EUR 800.000	Atos 1,75% 7/5/2025*	715.413	0,04	EUR 803.000	Cheplapharm Arzneimittel 3,5% 11/2/2027	792.915	0,05
EUR 700.000	Atos 2,5% 7/11/2028	541.120	0,03	EUR 255.000	Cheplapharm Arzneimittel 4,375% 15/1/2028	252.776	0,01
EUR 1.394.000	Banijay 6,5% 1/3/2026	1.497.335	0,09	EUR 351.000	Cheplapharm Arzneimittel 7,5% 15/5/2030	385.047	0,02
EUR 300.000	Banijay Entertainment 3,5% 1/3/2025	319.978	0,02	EUR 3.200.000	Commerzbank 6,125% 9/10/2025	3.153.285	0,19
USD 460.000	BNP Paribas 5,285% 28/3/2024	427.340	0,03	GBP 200.000	Commerzbank 8,625% 28/2/2033	250.447	0,02
USD 200.000	BNP Paribas 6,625% 25/3/2024	198.076	0,01	EUR 1.500.000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1,875% 15/10/2024*	1.026.754	0,06
EUR 400.000	BNP Paribas 6,875% 6/12/2029	419.342	0,03	EUR 600.000	Deutsche Lufthansa 2,875% 16/5/2027*	600.240	0,04
EUR 800.000	BNP Paribas 7,375% 11/6/2030	857.107	0,05	EUR 700.000	Deutsche Lufthansa 3,5% 14/7/2029	690.620	0,04
EUR 556.000	Burger King France 8,475% 1/11/2026	606.608	0,04	EUR 1.700.000	DIC Asset 2,25% 22/9/2026*	1.012.119	0,06
GBP 1.600.000	Clariane 4,125% 15/3/2024	1.568.945	0,09	EUR 2.778.000	Gruenenthal 4,125% 15/5/2028	2.820.737	0,17
USD 3.165.000	Constellium 3,75% 15/4/2029	2.720.536	0,17	EUR 174.000	Gruenenthal 6,75% 15/5/2030	194.349	0,01
EUR 370.000	Constellium 4,25% 15/2/2026	394.678	0,02	EUR 1.535.000	HT Troplast 9,375% 15/7/2028*	1.671.403	0,10
USD 1.096.000	Constellium 5,625% 15/6/2028	1.037.009	0,06	EUR 240.090	IHO Verwaltungs 3,75% 15/9/2026	248.018	0,01
USD 382.000	Constellium 5,875% 15/2/2026	376.503	0,02	EUR 806.000	IHO Verwaltungs 3,875% 15/5/2027	794.968	0,05
USD 925.000	Credit Agricole 4,75% 23/3/2029	725.961	0,04	EUR 1.023.000	IHO Verwaltungs 8,75% 15/5/2028	1.159.334	0,07
EUR 992.000	Crown European 3,375% 15/5/2025	1.057.076	0,06				
EUR 600.000	Electricite de France 2,875% 15/12/2026*	571.224	0,04				
EUR 200.000	Electricite de France 3% 3/9/2027	185.742	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Israël				EUR 299.000	Telecom Italia 2,75% 15/4/2025	312.274	0,02
USD 2.093.000	Bank Leumi Le-Israel 3,275% 29/1/2031	1.885.835	0,12	EUR 654.000	Telecom Italia 2,875% 28/1/2026	675.474	0,04
USD 2.511.223	Energian Israel Finance 4,5% 30/3/2024	2.486.111	0,15	EUR 300.000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	314.655	0,02
USD 788.819	Energian Israel Finance 4,875% 30/3/2026*	741.679	0,04	USD 346.000	Telecom Italia 5,303% 30/5/2024	341.885	0,02
USD 2.848.767	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033	2.887.938	0,17	EUR 2.495.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	2.737.351	0,17
USD 3.340.968	Leviathan Bond 6,125% 30/6/2025*	3.281.582	0,20	EUR 766.000	Telecom Italia 7,875% 31/7/2028	865.059	0,05
USD 2.124.000	Mizrahi Tefahot Bank 3,077% 7/4/2031*	1.862.482	0,11	EUR 1.332.000	UniCredit 2% 23/9/2029*	1.387.341	0,08
		13.145.627	0,79	EUR 1.207.000	UniCredit 2,731% 15/1/2032	1.173.665	0,07
				EUR 1.400.000	UniCredit 7,5% 3/6/2026*	1.522.721	0,09
						57.619.661	3,46
Italie				Jamaïque			
EUR 3.239.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	3.424.509	0,20	USD 38.669	Digicel International Finance/ Digicel international 8% 31/12/2026***	2.296	0,00
EUR 328.000	Azzurra Aeroporti 2,625% 30/5/2027	321.671	0,02	USD 955.000	Digicel International Finance/ Digicel international 8,75% 25/5/2024	874.766	0,05
EUR 2.343.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6,75% 2/3/2026	2.554.152	0,15	USD 1.992	Digicel International Finance/ Digicel international 13% 31/12/2025***	1.424	0,00
EUR 2.125.000	Banco BPM 2,875% 29/6/2031	2.063.430	0,12			878.486	0,05
EUR 1.109.000	Banco BPM 3,375% 19/1/2032*	1.069.348	0,06	Japon			
EUR 455.000	Banco BPM 4,25% 1/10/2029	486.863	0,03	EUR 3.149.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	3.304.688	0,20
EUR 1.900.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	2.074.826	0,13	EUR 349.000	SoftBank 3,125% 19/9/2025	359.948	0,02
EUR 667.000	Castor 8,776% 15/2/2029	684.458	0,04	EUR 1.470.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032*	1.249.495	0,08
EUR 1.481.000	Cedacri Mergerco 8,424% 15/5/2028	1.571.157	0,09	EUR 608.000	SoftBank 4% 19/9/2029	568.160	0,03
EUR 848.000	Cedacri Mergerco 9,281% 15/5/2028	906.293	0,06	EUR 300.000	SoftBank 4,5% 20/4/2025	319.620	0,02
EUR 917.000	Enel 6,375% 16/4/2028*	1.017.031	0,06	EUR 756.000	SoftBank 4,75% 30/7/2025*	804.630	0,05
EUR 1.227.000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11,125% 15/5/2028	1.330.869	0,08	EUR 513.000	SoftBank 5% 15/4/2028	525.348	0,03
USD 1.600.000	F-Brasile / F-Brasile US 7,375% 15/8/2026*	1.470.569	0,09			7.131.889	0,43
EUR 1.670.000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027*	1.954.606	0,12	Jersey			
EUR 1.789.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5,625% 1/8/2027*	1.817.881	0,11	EUR 272.902	Adient Global 3,5% 15/8/2024	291.530	0,02
EUR 455.000	IMA Industria Macchine Automatiche 3,75% 15/1/2028	441.953	0,02	USD 1.000.000	Boyce Park CLO 11,584% 21/4/2035	953.426	0,06
EUR 585.000	IMA Industria Macchine Automatiche 7,663% 15/1/2028	633.255	0,04	GBP 314.000	CPUK Finance 3,588% 28/8/2025	373.552	0,02
EUR 2.398.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,625% 21/10/2028	2.294.594	0,14	GBP 174.000	CPUK Finance 4,5% 28/8/2027	192.748	0,01
EUR 1.831.000	Inter Media and Communication 6,75% 9/2/2027	1.921.585	0,11	GBP 665.000	CPUK Finance 4,875% 28/8/2025	806.368	0,05
USD 695.000	Intesa Sanpaolo 4,198% 1/6/2032*	530.405	0,03	GBP 1.869.000	Galaxy Bidco 6,5% 31/7/2026	2.182.305	0,13
USD 510.000	Intesa Sanpaolo 4,95% 1/6/2042	340.384	0,02			4.799.929	0,29
GBP 150.000	Intesa Sanpaolo 5,148% 10/6/2030	159.638	0,01	Kazakhstan			
EUR 2.931.000	Intesa Sanpaolo 5,5% 1/3/2028*	2.762.603	0,17	USD 1.980.000	KazMunayGas National JSC 4,75% 19/4/2027	1.864.319	0,11
USD 500.000	Intesa Sanpaolo 5,71% 15/1/2026	479.260	0,03	USD 2.175.000	KazMunayGas National JSC 6,375% 24/10/2048	1.818.028	0,11
EUR 750.000	Intesa Sanpaolo 5,875% 20/1/2025*	786.246	0,05			3.682.347	0,22
EUR 1.173.000	Lottomatica 7,6% 1/6/2028	1.283.502	0,08	Liberia			
EUR 1.518.000	Lottomatica 9,75% 30/9/2027*	1.787.514	0,11	USD 353.000	Royal Caribbean Cruises 4,25% 1/7/2026	329.419	0,02
EUR 139.000	Mundys 1,625% 3/2/2025	144.793	0,01	USD 663.000	Royal Caribbean Cruises 5,375% 15/7/2027	623.370	0,03
EUR 1.100.000	Mundys 1,875% 12/2/2028	1.031.955	0,06	USD 687.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 31/8/2026	660.722	0,04
EUR 3.900.000	Nexi 0% 24/2/2028	3.310.494	0,20	USD 574.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 1/4/2028	539.495	0,03
EUR 1.750.000	Poste Italiane 2,625% 24/3/2029	1.485.697	0,09	USD 971.000	Royal Caribbean Cruises 7,25% 15/1/2030	986.486	0,06
EUR 2.462.000	Rekeep 7,25% 1/2/2026*	2.486.066	0,15	USD 659.000	Royal Caribbean Cruises 8,25% 15/1/2029	689.104	0,04
EUR 4.282.000	Telecom Italia 1,625% 18/1/2029	3.661.629	0,22	USD 1.850.000	Royal Caribbean Cruises 9,25% 15/1/2029	1.971.776	0,12
				USD 204.000	Royal Caribbean Cruises 11,5% 1/6/2025	215.815	0,01
				USD 652.000	Royal Caribbean Cruises 11,625% 15/8/2027	711.149	0,04
						6.727.336	0,39

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Luxembourg				EUR 645.000	Monitchem HoldCo 3 8,75% 1/5/2028	693.824	0,04
EUR 1.925.000	Adler Financing 12,5% 30/6/2025	2.156.751	0,13	USD 1.947.000	Petrorio Luxembourg Trading 6,125% 9/6/2026	1.877.580	0,11
USD 837.000	Albion Financing 1 / Aggreko 6,125% 15/10/2026	789.883	0,05	USD 1.250.000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	1.151.012	0,07
EUR 1.060.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3,625% 1/6/2028*	944.414	0,06	EUR 1.830.000	Rossini 6,75% 30/10/2025	2.002.822	0,12
USD 3.230.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	2.732.262	0,16	EUR 1.360.000	SES 2,875% 27/5/2026	1.286.880	0,08
USD 1.563.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	1.322.671	0,08	EUR 1.452.000	SES 5,625% 29/1/2024	1.576.443	0,09
GBP 290.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,875% 1/6/2028	292.384	0,02	USD 2.359.000	SK Invictus Intermediate II 5% 30/10/2029*	1.921.822	0,12
EUR 1.421.000	Altice Financing 2,25% 15/1/2025	1.476.185	0,09	EUR 475.000	Stena International 7,25% 15/2/2028	533.147	0,03
EUR 429.000	Altice Financing 3% 15/1/2028	362.572	0,02	EUR 1.551.000	Summer BC Holdco B 5,75% 31/10/2026	1.529.788	0,09
EUR 825.000	Altice Financing 4,25% 15/8/2029*	684.548	0,04	USD 1.566.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	1.300.776	0,08
USD 1.139.000	Altice Financing 5% 15/1/2028	928.038	0,06	USD 1.723.000	Telecom Italia Capital 6,375% 15/11/2033	1.507.485	0,09
USD 3.023.000	Altice Financing 5,75% 15/8/2029*	2.398.519	0,15	USD 277.000	Telecom Italia Capital 7,2% 18/7/2036	249.340	0,01
EUR 802.000	Aramark International Finance 3,125% 1/4/2025*	848.669	0,05	USD 115.000	Telecom Italia Capital 7,721% 4/6/2038	105.902	0,01
USD 3.055.625	ARD Finance 6,5% 30/6/2027	2.462.839	0,15	USD 600.000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5,5% 1/3/2028	551.400	0,03
EUR 2.200.000	Aroundtown 3,375% 23/9/2024	1.000.222	0,06			64.431.940	3,87
USD 910.000	Camelot Finance 4,5% 1/11/2026	852.767	0,05	Malte			
EUR 433.000	Cidron Aida Finco 5% 1/4/2028	431.304	0,02	USD 716.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6,375% 1/2/2030	587.471	0,04
GBP 1.441.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	1.614.231	0,10	USD 437.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 7,875% 1/5/2027*	396.361	0,02
EUR 998.000	Cirsa Finance International 4,75% 22/5/2025	1.071.547	0,06			983.832	0,06
EUR 442.000	Cirsa Finance International 7,875% 31/7/2028	482.812	0,03	Îles Marshall			
EUR 678.000	Cirsa Finance International 8,185% 31/7/2028	735.038	0,04	USD 2.111.000	Danaos 8,5% 1/3/2028	2.138.204	0,13
EUR 320.000	Cirsa Finance International 10,375% 30/11/2027*	375.007	0,02	Maurice			
EUR 2.081.073	Codere Finance 2 Luxembourg 11% 30/9/2026	1.692.801	0,10	USD 200.000	Azure Power Solar Energy Pvt 5,65% 24/12/2024	175.820	0,01
USD 5.596.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	5.311.802	0,32	USD 2.488.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	2.234.821	0,14
USD 2.232.000	CSN Resources 4,625% 10/6/2031	1.696.766	0,10	USD 400.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	359.296	0,02
EUR 2.015.000	Cullinan Holdco Scsp 4,625% 15/10/2026*	1.833.471	0,11	USD 200.000	Greenko Solar Mauritius 5,95% 29/7/2026	188.495	0,01
EUR 375.000	Dana Financing Luxembourg 3% 15/7/2029	322.800	0,02	USD 400.000	Greenko Wind Projects Mauritius 5,5% 6/4/2025	385.696	0,02
EUR 1.413.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	1.572.242	0,10	USD 250.000	India Airport Infra 6,25% 25/10/2025	244.924	0,01
EUR 1.700.000	European TopSoho 4% 21/9/2021***	1.420.193	0,09	USD 250.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024	246.250	0,02
EUR 971.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	816.301	0,05	USD 250.000	India Green Power 4% 22/2/2027	221.460	0,01
GBP 1.158.000	Garfunkelux Holdco 3 7,75% 1/11/2025	1.120.911	0,07	USD 1.807.000	MTN Mauritius Investments 6,5% 13/10/2026*	1.779.470	0,11
USD 2.008.000	Herens Holdco 4,75% 15/5/2028	1.544.498	0,09	USD 200.000	Network i2i 3,975% 3/3/2026*	183.599	0,01
EUR 180.000	Herens Midco 5,25% 15/5/2029	105.263	0,01	USD 400.000	Network i2i 5,65% 15/1/2025	389.366	0,03
USD 1.080.000	ION Trading Technologies 5,75% 15/5/2028*	949.705	0,06			6.409.197	0,39
USD 1.924.000	Kenbourne Invest 6,875% 26/11/2024	1.620.393	0,10	Mexique			
EUR 1.583.000	Kleopatra Finco 4,25% 1/3/2026*	1.429.844	0,08	USD 860.000	Banco Mercantil del Norte 6,625% 24/1/2032	695.912	0,04
EUR 766.000	LHMC Finco 2 7,25% 2/10/2025	830.328	0,05	USD 1.048.000	Banco Mercantil del Norte 7,5% 27/6/2029	959.669	0,06
USD 2.124.900	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028	1.913.738	0,11	USD 1.830.000	Banco Mercantil del Norte 7,625% 10/1/2028*	1.716.247	0,10
				USD 4.409.000	BBVA Bancomer 5,125% 18/1/2033	3.816.452	0,23
				USD 1.540.000	BBVA Bancomer 5,875% 13/9/2034	1.372.517	0,08
				USD 5.226.000	Cemex 5,125% 8/6/2026*	4.849.571	0,29
				USD 2.315.000	Cemex 9,125% 14/3/2028*	2.417.138	0,15

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.433.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari 6,95% 14/3/2026	2.387.174	0,14	USD 1.031.000	Merlin Entertainments 5,75% 15/6/2026	994.439	0,06
		7.017.893	0,42	GBP 1.431.000	Mobico 4,25% 26/11/2025	1.583.356	0,10
				GBP 736.000	Nationwide Building Society 5,75% 20/6/2027	803.104	0,05
	Émirats arabes unis			USD 2.213.000	Neptune Energy Bondco 6,625% 15/5/2025	2.203.927	0,13
USD 3.700.000	Alpha Star VII 7,75% 27/4/2026*	3.750.856	0,22	USD 400.000	Neptune Energy Bondco 6,625% 15/5/2025	398.360	0,03
	Royaume-Uni			USD 215.000	Odeon Finco 12,75% 1/11/2027	211.738	0,01
EUR 3.100.000	Agps Bondco 5,5% 13/11/2026	1.130.920	0,07	GBP 440.000	Pinewood Finance 3,625% 15/11/2027*	484.869	0,03
EUR 1.300.000	Agps Bondco 6% 5/8/2025	548.586	0,03	GBP 879.000	Premier Foods Finance 3,5% 15/10/2026	1.008.158	0,06
EUR 2.218.000	Allwyn Entertainment Financing UK 7,25% 30/4/2030	2.458.168	0,15	GBP 964.000	Santander UK 6,75% 24/6/2024*	1.184.395	0,07
USD 500.000	Allwyn Entertainment Financing UK 7,875% 30/4/2029*	508.263	0,03	GBP 611.000	Stonegate Pub Financing 2019 8% 13/7/2025	713.842	0,04
USD 2.075.000	Barclays 4,375% 15/3/2028	1.427.356	0,09	GBP 546.000	Stonegate Pub Financing 2019 8,25% 31/7/2025	640.192	0,04
USD 400.000	Barclays 5,2% 12/5/2026	388.295	0,02	EUR 1.864.000	Synthomer 3,875% 1/7/2025*	1.872.736	0,11
GBP 288.000	Barclays 5,875% 15/9/2024	337.914	0,02	GBP 422.000	Thames Water Kemble Finance 4,625% 19/5/2026	362.427	0,02
GBP 200.000	Barclays 6,375% 15/12/2025	225.325	0,01	EUR 790.000	Thames Water Utilities Finance 4% 18/4/2027	820.680	0,05
GBP 1.400.000	Barclays 7,125% 15/6/2025	1.638.829	0,10	GBP 1.177.000	Unique Pub Finance 6,464% 30/3/2032	1.448.808	0,09
USD 200.000	Barclays 8% 15/6/2024	196.203	0,01	GBP 508.000	Virgin Media Secured Finance 4,25% 15/1/2030	514.181	0,03
USD 690.000	Barclays 8% 15/3/2029	616.039	0,04	USD 472.000	Virgin Media Secured Finance 4,5% 15/8/2030	398.864	0,02
GBP 700.000	BCP V Modular Services Finance II 6,125% 30/11/2028*	728.106	0,04	GBP 2.084.000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	2.413.268	0,14
GBP 2.887.000	Bellis Acquisition 3,25% 16/2/2026	3.146.432	0,19	GBP 286.000	Virgin Media Secured Finance 5,25% 15/5/2029	308.847	0,02
GBP 2.024.000	Bellis Acquisition 4,5% 16/2/2026	2.253.321	0,14	GBP 1.100.000	Vmed O2 UK Financing I 4% 31/1/2029	1.117.986	0,07
EUR 358.000	British Telecommunications 1,874% 18/8/2080	355.318	0,02	GBP 2.174.000	Vmed O2 UK Financing I 4,5% 15/7/2031	2.141.918	0,13
USD 670.000	British Telecommunications 4,25% 23/11/2081	591.604	0,04	USD 943.000	Vmed O2 UK Financing I 4,75% 15/7/2031	785.626	0,05
GBP 2.325.000	British Telecommunications 8,375% 20/12/2083	2.951.899	0,18	EUR 600.000	Vodafone 2,625% 27/8/2080	594.919	0,04
EUR 308.000	Carnival 1% 28/10/2029	224.302	0,01	EUR 1.764.000	Vodafone 4,2% 3/10/2078	1.772.697	0,11
EUR 177.721	Codere New Topco 7,5% 30/11/2027	9.161	0,00	GBP 1.444.000	Vodafone 4,875% 3/10/2078	1.725.325	0,10
GBP 1.308.000	Constellation Automotive Financing 4,875% 15/7/2027*	1.329.644	0,08	USD 739.000	Vodafone 6,25% 3/10/2078*	728.839	0,04
EUR 1.039.000	EC Finance 3% 15/10/2026	1.060.677	0,06	EUR 500.000	Vodafone 6,5% 30/8/2084	549.864	0,03
USD 1.627.000	eG Global Finance 6,75% 7/2/2025	1.599.983	0,10			63.157.154	3,80
USD 622.000	eG Global Finance 8,5% 30/10/2025	616.539	0,04		États-Unis		
USD 200.000	EnQuest 11,625% 1/11/2027	189.452	0,01	USD 260.000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	240.156	0,02
GBP 1.050.000	Gatwick Airport Finance 4,375% 7/4/2026	1.221.202	0,07	USD 312.000	Acadia Healthcare 5,5% 1/7/2028	295.145	0,02
GBP 100.000	Greene King Finance 6,903% 15/12/2034	100.924	0,01	USD 598.000	ACI Worldwide 5,75% 15/8/2026	585.517	0,04
GBP 100.000	Greene King Finance 7,08% 15/3/2036	100.109	0,00	USD 601.000	Acrisure / Acrisure Finance 6% 1/8/2029	522.271	0,03
USD 376.000	Harbour Energy 5,5% 15/10/2026*	351.428	0,02	USD 2.027.000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	1.643.786	0,10
GBP 767.000	Heathrow Finance 3,875% 1/3/2027	839.191	0,05	USD 209.000	AdaptHealth 5,125% 1/3/2030	172.373	0,01
GBP 750.000	Heathrow Finance 4,125% 1/9/2029	769.865	0,05	USD 217.000	AdaptHealth 6,125% 1/8/2028	196.054	0,01
GBP 1.088.000	Heathrow Finance 4,75% 1/3/2024	1.355.233	0,08	USD 193.000	ADT Security 4,875% 15/7/2032	166.763	0,01
USD 285.000	HSBC 4,6% 17/12/2030	221.148	0,01	USD 885.000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	844.896	0,05
EUR 1.109.000	INEOS Finance 6,625% 15/5/2028*	1.197.146	0,07	USD 1.648.000	Advanced Drainage Systems 6,375% 15/6/2030	1.630.515	0,10
EUR 2.484.000	INEOS Quattro Finance 2 2,5% 15/1/2026	2.457.776	0,15	USD 2.467.000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8,25% 15/2/2026	2.481.555	0,15
GBP 1.067.000	Iron Mountain UK 3,875% 15/11/2025	1.275.025	0,08	USD 653.000	Ahead DB 6,625% 1/5/2028	564.563	0,03
USD 850.000	Lloyds Banking 8% 27/9/2029	771.495	0,05	USD 1.548.000	AHP Health Partners 5,75% 15/7/2029	1.322.931	0,08
GBP 154.000	Marks & Spencer 3,75% 19/5/2026	180.911	0,01	USD 1.540.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,25% 15/3/2026	1.433.392	0,09

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 836.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,5% 15/3/2029	724.944	0,04	USD 485.000	APi DE 4,75% 15/10/2029	438.978	0,03
USD 871.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,625% 15/1/2027	824.681	0,04	USD 1.228.000	APX 5,75% 15/7/2029	1.060.182	0,06
USD 646.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,875% 15/2/2030	593.492	0,04	USD 720.000	APX 6,75% 15/2/2027	697.466	0,04
USD 216.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5,875% 15/2/2028	209.768	0,01	USD 1.123.000	Aramark Services 5% 1/4/2025	1.110.158	0,07
USD 521.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6,5% 15/2/2028	518.932	0,03	USD 1.859.000	Aramark Services 5% 1/2/2028	1.736.499	0,10
USD 560.000	Alexander Funding Trust II 7,467% 31/7/2028	566.143	0,03	USD 1.334.000	Aramark Services 6,375% 1/5/2025	1.338.892	0,08
USD 413.000	Allegiant Travel 7,25% 15/8/2027	404.659	0,02	USD 336.000	Arches Buyer 4,25% 1/6/2028	292.971	0,02
USD 4.343.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4,25% 15/10/2027	3.955.557	0,24	USD 3.387.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,25% 1/4/2028	3.241.867	0,19
USD 4.191.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 5,875% 1/11/2029	3.669.906	0,22	USD 1.829.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,875% 1/4/2027	1.800.925	0,11
USD 7.929.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/10/2027	7.496.873	0,45	USD 1.676.000	Arcosa 4,375% 15/4/2029	1.500.607	0,09
USD 2.073.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/4/2028	2.045.002	0,12	EUR 1.181.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028	1.064.271	0,06
USD 4.539.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6% 1/6/2029	3.475.075	0,21	EUR 1.400.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029	1.142.116	0,07
USD 4.954.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6,625% 15/7/2026	4.721.590	0,28	USD 415.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3,25% 1/9/2028	352.842	0,02
USD 1.405.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 9,75% 15/7/2027	1.291.053	0,08	USD 4.839.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	3.933.962	0,24
USD 822.000	Alteryx 8,75% 15/3/2028*	795.285	0,05	USD 1.126.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	1.103.914	0,07
USD 492.000	AMC Networks 4,25% 15/2/2029	314.580	0,02	USD 460.000	Ares Capital 7% 15/1/2027	461.055	0,03
USD 200.000	AMC Networks 4,75% 1/8/2025	187.428	0,01	USD 874.000	Arko 5,125% 15/11/2029	718.944	0,04
USD 239.000	American Airlines 7,25% 15/2/2028	235.162	0,01	USD 456.000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	465.106	0,03
USD 460.131	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,5% 20/4/2026	452.495	0,03	USD 380.000	Asbury Automotive 4,5% 1/3/2028	346.921	0,02
USD 1.630.412	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,75% 20/4/2029	1.566.861	0,09	USD 65.000	Asbury Automotive 4,75% 1/3/2030	56.982	0,00
USD 47.000	American Builders & Contractors Supply 3,875% 15/11/2029	40.655	0,00	USD 602.000	Asbury Automotive 5% 15/2/2032	516.025	0,03
USD 695.000	American Express 5,625% 28/7/2034	682.657	0,04	USD 1.920.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5,875% 30/6/2029	1.750.108	0,11
USD 833.000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9,375% 1/6/2028	851.919	0,05	USD 165.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 8,25% 31/12/2028	165.187	0,01
USD 285.000	AMN Healthcare 4% 15/4/2029	243.946	0,01	USD 1.839.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 9% 1/11/2027	2.319.944	0,14
USD 401.000	Amsted Industries 5,625% 1/7/2027	389.780	0,02	USD 653.000	Ashland 3,375% 1/9/2031	523.454	0,04
USD 1.251.000	AmWINS 4,875% 30/6/2029	1.123.282	0,07	USD 958.000	Ashtead Capital 5,95% 15/10/2033	940.470	0,06
USD 534.000	ANGI 3,875% 15/8/2028	427.377	0,03	USD 401.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	345.802	0,02
USD 1.018.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,375% 15/6/2029	955.031	0,06	USD 647.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/4/2030	552.224	0,03
USD 589.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,75% 1/3/2027	571.580	0,03	USD 180.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6,625% 15/1/2028	172.549	0,01
USD 245.000	Antero Resources 7,625% 1/2/2029	249.995	0,02	USD 6.484.000	AthenaHealth 6,5% 15/2/2030	5.622.930	0,34
USD 1.153.600	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	1.048.616	0,06	USD 477.000	ATI 4,875% 1/10/2029	431.129	0,03
USD 423.000	Apache 5,35% 1/7/2049	339.857	0,02	USD 1.257.000	ATI 5,125% 1/10/2031	1.112.520	0,07
USD 595.000	APi DE 4,125% 15/7/2029	514.766	0,03	USD 857.000	ATI 5,875% 1/12/2027	834.915	0,05
				USD 1.694.000	ATI 7,25% 15/8/2030	1.711.059	0,10
				EUR 320.000	Avantor Funding 2,625% 1/11/2025	330.735	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 100.000	Avantor Funding 3,875% 15/7/2028*	100.196	0,01	USD 970.000	Cable One 4% 15/11/2030	757.412	0,05
USD 723.000	Avantor Funding 3,875% 1/11/2029	634.143	0,04	USD 944.000	Cablevision Lightpath 3,875% 15/9/2027	786.212	0,05
USD 1.654.000	Avantor Funding 4,625% 15/7/2028	1.536.366	0,09	USD 584.000	Cablevision Lightpath 5,625% 15/9/2028	449.459	0,03
USD 403.000	Avient 7,125% 1/8/2030	403.897	0,02	USD 1.032.000	Caesars Entertainment 4,625% 15/10/2029	905.426	0,05
USD 1.927.000	Axalta Coating Systems 3,375% 15/2/2029	1.636.033	0,10	USD 3.743.000	Caesars Entertainment 6,25% 1/7/2025	3.716.342	0,22
USD 387.000	Axalta Coating Systems / Axalta Coating Systems Dutch B 4,75% 15/6/2027	364.341	0,02	USD 3.658.000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	3.666.180	0,22
USD 1.415.000	Azul Secured Finance 11,93% 28/8/2028	1.409.135	0,08	USD 4.257.000	Caesars Entertainment 8,125% 1/7/2027	4.330.297	0,26
USD 378.000	Ball 3,125% 15/9/2031	306.823	0,02	USD 584.000	Caesars Resort Collection / CRC Finco 5,75% 1/7/2025*	584.696	0,04
USD 653.000	Ball 6% 15/6/2029	643.234	0,04	USD 624.000	Callon Petroleum 6,375% 1/7/2026	616.418	0,04
EUR 1.001.000	Banff Merger Sub 8,375% 1/9/2026	1.061.377	0,06	USD 2.730.000	Callon Petroleum 7,5% 15/6/2030*	2.687.722	0,16
USD 1.254.000	BCPE Empire 7,625% 1/5/2027	1.183.024	0,07	USD 2.374.000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	2.408.169	0,15
USD 487.000	Beacon Roofing Supply 4,125% 15/5/2029	419.873	0,03	USD 230.000	Calpine 4,625% 1/2/2029	200.106	0,01
USD 851.000	Beacon Roofing Supply 6,5% 1/8/2030	839.230	0,05	USD 147.000	Calpine 5% 1/2/2031	124.743	0,01
USD 5.155.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	5.132.549	0,31	USD 1.119.000	Calpine 5,125% 15/3/2028	1.023.310	0,06
USD 1.156.000	Black Knight InfoServ 3,625% 1/9/2028	1.072.190	0,06	USD 9.000	Calpine 5,25% 1/6/2026	8.849	0,00
USD 248.000	Blackstone Private Credit Fund 3,25% 15/3/2027	216.191	0,01	USD 750.000	Camelot Return Merger Sub 8,75% 1/8/2028	743.565	0,04
USD 276.000	Blackstone Private Credit Fund 7,05% 29/9/2025	277.779	0,02	USD 465.000	Capital One Financial 6,312% 8/6/2029	464.618	0,03
USD 2.367.000	Block 2,75% 1/6/2026	2.150.716	0,13	USD 335.000	Capital One Financial 6,377% 8/6/2034	331.705	0,02
USD 3.772.000	Block 3,5% 1/6/2031	3.101.770	0,19	USD 1.064.000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	1.048.854	0,06
USD 242.000	Block Communications 4,875% 1/3/2028	200.499	0,01	USD 308.000	Carpenter Technology 6,375% 15/7/2028	301.316	0,02
USD 211.000	Blue Owl Capital 3,4% 15/7/2026	190.160	0,01	USD 871.000	Carpenter Technology 7,625% 15/3/2030	878.035	0,05
USD 611.000	Blue Owl Capital 3,75% 22/7/2025	572.988	0,03	EUR 1.792.000	Catalent Pharma Solutions 2,375% 1/3/2028	1.628.393	0,10
USD 142.000	Blue Owl Credit Income 3,125% 23/9/2026	125.113	0,01	USD 790.000	Catalent Pharma Solutions 3,125% 15/2/2029	664.311	0,04
USD 701.000	Blue Owl Credit Income 5,5% 21/3/2025	679.583	0,04	USD 1.429.000	Catalent Pharma Solutions 3,5% 1/4/2030	1.202.739	0,07
USD 1.099.000	Blue Owl Credit Income 7,75% 16/9/2027	1.092.150	0,07	USD 191.000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	178.531	0,01
USD 104.000	Booz Allen Hamilton 3,875% 1/9/2028	94.313	0,01	USD 243.000	CCM Merger 6,375% 1/5/2026	236.110	0,01
USD 1.861.000	Booz Allen Hamilton 4% 1/7/2029	1.667.427	0,10	USD 2.580.000	CCO / CCO Capital 4,25% 1/2/2031	2.124.287	0,12
EUR 2.875.000	Boxer Parent 6,5% 2/10/2025	3.099.255	0,19	USD 806.000	CCO / CCO Capital 4,25% 15/1/2034	618.082	0,04
USD 2.050.000	Boxer Parent 7,125% 2/10/2025	2.054.408	0,12	USD 389.000	CCO / CCO Capital 4,5% 15/8/2030	327.939	0,02
USD 2.299.000	Boxer Parent 9,125% 1/3/2026	2.303.021	0,14	USD 1.069.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/3/2030	922.761	0,06
USD 387.000	Boyd Gaming 4,75% 1/12/2027	362.937	0,02	USD 1.310.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/2/2032	1.087.582	0,07
USD 2.188.000	Boyd Gaming 4,75% 15/6/2031	1.935.745	0,12	USD 722.000	CCO / CCO Capital 5,125% 1/5/2027	681.108	0,04
USD 1.492.000	Boyne USA 4,75% 15/5/2029	1.346.480	0,08	USD 729.000	CCO / CCO Capital 5,375% 1/6/2029	666.380	0,04
USD 5.052.000	Brand Industrial Services 10,375% 1/8/2030	5.188.483	0,31	USD 2.665.000	CCO / CCO Capital 6,375% 1/9/2029	2.528.962	0,15
USD 209.000	Brink's 5,5% 15/7/2025	205.969	0,01	USD 4.885.000	CCO / CCO Capital 7,375% 1/3/2031	4.860.256	0,29
USD 735.000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGSII Sellco LL 4,5% 1/4/2027	614.599	0,04	USD 783.000	CD&R Smokey Buyer 6,75% 15/7/2025*	763.112	0,05
USD 564.000	Buckeye Partners 4,125% 1/3/2025	542.681	0,03	USD 2.071.000	CDI Escrow Issuer 5,75% 1/4/2030	1.935.218	0,12
USD 297.000	Buckeye Partners 5,6% 15/10/2044	218.643	0,01	USD 433.000	CDW / CDW Finance 3,25% 15/2/2029	376.581	0,02
USD 481.000	Buckeye Partners 5,85% 15/11/2043	371.897	0,02	USD 323.000	Cedar Fair 5,25% 15/7/2029*	291.093	0,02
USD 311.000	Cable One 0% 15/3/2026	257.175	0,02				
USD 914.000	Cable One 1,125% 15/3/2028	693.057	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 857.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,5% 1/5/2025	851.364	0,05	USD 2.787.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	2.502.207	0,15
USD 178.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 6,5% 1/10/2028	172.343	0,01	USD 1.745.000	Clear Channel Outdoor 7,5% 1/6/2029*	1.302.079	0,08
USD 1.956.000	Centene 3% 15/10/2030	1.625.365	0,10	USD 1.858.000	Clear Channel Outdoor 7,75% 15/4/2028	1.456.182	0,09
USD 866.000	Central Garden & Pet 4,125% 15/10/2030	746.228	0,04	USD 2.512.000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	2.524.309	0,15
USD 779.000	Central Garden & Pet 4,125% 30/4/2031	665.376	0,04	USD 871.000	Clearway Energy Operating 3,75% 15/1/2032	711.587	0,04
USD 361.000	Central Garden & Pet 5,125% 1/2/2028	339.802	0,02	USD 337.000	Clearway Energy Operating 4,75% 15/3/2028	312.601	0,02
USD 1.993.000	Central Parent / CDK Global 7,25% 15/6/2029	1.969.614	0,12	USD 12.494.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	11.175.415	0,67
USD 1.469.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	1.488.838	0,09	USD 5.124.000	Cloud Software 9% 30/9/2029	4.582.663	0,28
USD 345.000	Charles River Laboratories International 4% 15/3/2031	298.174	0,02	USD 2.576.000	Clydesdale Acquisition 6,625% 15/4/2029	2.454.817	0,15
USD 466.000	Charles River Laboratories International 4,25% 1/5/2028	427.685	0,03	USD 1.479.000	Clydesdale Acquisition 8,75% 15/4/2030	1.338.178	0,08
USD 2.741.000	Chart Industries 7,5% 1/1/2030	2.816.092	0,17	USD 1.096.000	CMG Media 8,875% 15/12/2027	860.883	0,05
USD 327.000	Chart Industries 9,5% 1/1/2031	352.818	0,02	USD 912.000	CNX Midstream Partners 4,75% 15/4/2030	787.867	0,04
USD 296.000	Chemours 4,625% 15/11/2029	246.320	0,01	USD 341.000	CNX Resources 7,375% 15/1/2031	340.358	0,02
USD 510.000	Chemours 5,75% 15/11/2028	457.081	0,03	USD 1.674.000	Coherent 5% 15/12/2029*	1.482.500	0,09
USD 1.697.000	Cheniere Energy Partners 3,25% 31/1/2032	1.401.761	0,08	USD 1.100.000	CommScope 4,75% 1/9/2029	818.214	0,05
USD 1.532.000	Cheniere Energy Partners 4,5% 1/10/2029	1.414.183	0,09	USD 1.536.000	CommScope 6% 1/3/2026	1.392.897	0,08
USD 74.000	Chesapeake Energy 5,875% 1/2/2029	70.873	0,00	USD 1.918.000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	1.755.128	0,11
USD 2.406.000	Chesapeake Energy 6,75% 15/4/2029	2.390.577	0,14	USD 934.000	Compass Diversified 5,25% 15/4/2029	858.468	0,05
USD 3.514.000	Chobani / Chobani Finance 4,625% 15/11/2028	3.156.307	0,19	USD 345.000	Consensus Cloud Solutions 6% 15/10/2026	321.568	0,02
USD 6.327.000	Chobani / Chobani Finance 7,5% 15/4/2025	6.317.892	0,38	USD 319.000	Consensus Cloud Solutions 6,5% 15/10/2028*	287.120	0,02
USD 1.274.000	CHS/Community Health Systems 4,75% 15/2/2031	958.558	0,06	USD 3.390.000	CoreLogic 4,5% 1/5/2028	2.774.376	0,17
USD 1.949.000	CHS/Community Health Systems 5,25% 15/5/2030	1.537.657	0,10	EUR 2.593.000	Coty 3,875% 15/4/2026	2.736.545	0,16
USD 2.519.000	CHS/Community Health Systems 5,625% 15/3/2027	2.227.579	0,13	USD 62.000	Coty/HFC Prestige Products/ HFC Prestige International US 4,75% 15/1/2029	56.864	0,00
USD 1.784.000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	1.496.116	0,09	USD 860.000	Coty/HFC Prestige Products/ HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030*	857.593	0,05
USD 1.926.000	Churchill Downs 4,75% 15/1/2028	1.780.166	0,11	USD 677.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	582.880	0,03
USD 1.089.000	Churchill Downs 5,5% 1/4/2027	1.050.059	0,06	USD 237.000	Covanta 5% 1/9/2030	201.406	0,01
USD 1.369.000	Churchill Downs 6,75% 1/5/2031	1.335.623	0,08	USD 3.527.000	CQP Holdco / BIP-V Chinook Holdco 5,5% 15/6/2031	3.213.369	0,19
USD 1.425.000	Citigroup 6,174% 25/5/2034	1.423.678	0,09	USD 3.201.000	Crescent Energy Finance 7,25% 1/5/2026	3.149.918	0,19
USD 2.686.000	Civitas Resources 8,375% 1/7/2028	2.761.217	0,17	USD 922.000	Crescent Energy Finance 9,25% 15/2/2028	943.728	0,06
USD 2.110.000	Civitas Resources 8,75% 1/7/2031	2.180.920	0,13	USD 220.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 5,625% 1/5/2027	213.717	0,01
USD 2.090.000	Clarios Global 6,75% 15/5/2025	2.093.871	0,13	USD 1.272.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	1.238.579	0,07
EUR 1.970.000	Clarios Global / Clarios US Finance 4,375% 15/5/2026	2.069.823	0,12	USD 340.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 7,375% 1/2/2031	349.709	0,02
USD 2.761.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,75% 15/5/2028	2.756.701	0,17	USD 187.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 8% 1/4/2029	193.295	0,01
USD 4.830.000	Clarivate Science 3,875% 1/7/2028	4.259.479	0,26	USD 525.000	Crocs 4,125% 15/8/2031	416.535	0,02
USD 2.415.000	Clarivate Science 4,875% 1/7/2029	2.109.727	0,12	USD 334.000	Crocs 4,25% 15/3/2029	281.936	0,02
USD 291.000	Clean Harbors 4,875% 15/7/2027	278.801	0,02	USD 144.000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	123.537	0,01
USD 1.175.000	Clean Harbors 5,125% 15/7/2029	1.112.326	0,07	USD 60.000	Crown Americas / Crown Americas Capital V 4,25% 30/9/2026	56.611	0,00
USD 384.000	Clean Harbors 6,375% 1/2/2031	382.287	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 92.000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4,75% 1/2/2026	88.806	0,01	USD 252.000	EnLink Midstream Partners 5,45% 1/6/2047	209.404	0,01
USD 221.000	Crown Cork & Seal 7,375% 15/12/2026	228.569	0,01	USD 413.000	EnLink Midstream Partners 5,6% 1/4/2044	347.664	0,02
USD 211.000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	195.424	0,01	USD 1.252.000	EnPro Industries 5,75% 15/10/2026	1.222.008	0,08
USD 2.252.000	CrownRock / CrownRock Finance 5,625% 15/10/2025	2.214.617	0,13	USD 214.000	Entegris 4,375% 15/4/2028	196.272	0,01
USD 973.000	CSC 4,125% 1/12/2030	694.713	0,04	USD 6.832.000	Entegris Escrow 4,75% 15/4/2029	6.349.642	0,39
USD 698.000	CSC 4,5% 15/11/2031	497.547	0,03	USD 372.000	Entegris Escrow 5,95% 15/6/2030	356.890	0,02
USD 1.965.000	CSC 5,5% 15/4/2027	1.695.825	0,10	USD 334.000	EQM Midstream Partners 4,125% 1/12/2026	313.937	0,02
USD 5.360.000	CSC 11,25% 15/5/2028	5.291.124	0,32	USD 100.000	EQM Midstream Partners 4,5% 15/1/2029	90.824	0,01
USD 1.162.000	Cushman & Wakefield US Borrower 6,75% 15/5/2028	1.099.781	0,07	USD 1.612.000	EQM Midstream Partners 4,75% 15/1/2031	1.426.982	0,09
USD 481.000	Cushman & Wakefield US Borrower 8,875% 1/9/2031	486.354	0,03	USD 387.000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	383.657	0,03
USD 1.343.000	Darling Ingredients 6% 15/6/2030	1.315.720	0,08	USD 1.039.000	EQM Midstream Partners 6,5% 1/7/2027	1.032.037	0,06
USD 291.000	DCP Midstream Operating 6,45% 3/11/2036	296.931	0,02	USD 329.000	EQM Midstream Partners 7,5% 1/6/2030	337.785	0,02
USD 516.000	Dealer Tire / DT Issuer 8% 1/2/2028*	482.188	0,03	USD 1.143.000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	1.046.010	0,06
USD 1.025.000	Diamondback Energy 6,25% 15/3/2033	1.057.566	0,07	USD 223.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4,625% 15/1/2029	192.547	0,01
USD 1.366.000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5,875% 15/8/2027	1.213.527	0,07	USD 254.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 6,75% 15/1/2030	210.190	0,01
USD 290.000	Discover Financial Services 6,7% 29/11/2032	288.848	0,02	USD 4.179.000	First-Citizens Bank & Trust 6% 1/4/2036	3.731.412	0,22
USD 372.000	Dream Finders Homes 8,25% 15/8/2028	377.513	0,02	USD 2.256.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032	1.764.451	0,11
USD 1.545.000	DT Midstream 4,125% 15/6/2029	1.368.189	0,08	USD 1.251.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	1.194.012	0,07
USD 1.499.000	DT Midstream 4,375% 15/6/2031	1.294.977	0,08	USD 526.000	Ford Motor Credit 2,7% 10/8/2026	471.661	0,03
USD 3.019.000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029*	2.698.347	0,17	GBP 936.000	Ford Motor Credit 2,748% 14/6/2024	1.143.064	0,07
USD 624.000	Dycor Industries 4,5% 15/4/2029	558.181	0,03	USD 300.000	Ford Motor Credit 3,375% 13/11/2025	279.815	0,02
USD 6.269.000	Element Solutions 3,875% 1/9/2028	5.513.055	0,33	USD 699.000	Ford Motor Credit 3,625% 17/6/2031	566.523	0,03
USD 321.000	Embeckta 6,75% 15/2/2030	283.255	0,02	USD 829.000	Ford Motor Credit 3,81% 9/1/2024	822.011	0,05
EUR 540.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	585.352	0,03	USD 860.000	Ford Motor Credit 4,389% 8/1/2026	815.247	0,05
EUR 661.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	717.310	0,04	GBP 2.034.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	2.465.930	0,15
USD 8.817.000	Emerald Debt Merger Sub 6,625% 15/12/2030	8.676.474	0,52	USD 200.000	Ford Motor Credit 4,687% 9/6/2025	192.933	0,01
USD 1.695.000	Enact 6,5% 15/8/2025	1.681.058	0,10	USD 996.000	Ford Motor Credit 4,95% 28/5/2027	934.982	0,06
USD 167.000	Encompass Health 4,5% 1/2/2028	155.573	0,01	USD 1.036.000	Ford Motor Credit 5,113% 3/5/2029	953.225	0,06
USD 937.000	Encompass Health 4,625% 1/4/2031	821.410	0,05	USD 1.169.000	Ford Motor Credit 5,125% 16/6/2025	1.138.683	0,07
USD 1.352.000	Encompass Health 4,75% 1/2/2030	1.234.468	0,08	EUR 714.000	Ford Motor Credit 6,125% 15/5/2028	795.466	0,05
GBP 500.000	Encore Capital 4,25% 1/6/2028	488.844	0,03	GBP 1.633.000	Ford Motor Credit 6,86% 5/6/2026	2.020.608	0,12
EUR 1.342.000	Encore Capital 4,875% 15/10/2025*	1.392.508	0,08	USD 2.641.000	Ford Motor Credit 7,2% 10/6/2030	2.674.028	0,16
GBP 700.000	Encore Capital 5,375% 15/2/2026*	800.137	0,05	USD 2.281.000	Ford Motor Credit 7,35% 6/3/2030	2.324.300	0,14
USD 1.088.000	EnLink Midstream 5,375% 1/6/2029	1.039.983	0,06	USD 656.000	Fortrea 7,5% 1/7/2030	648.128	0,04
USD 1.357.000	EnLink Midstream 5,625% 15/1/2028	1.314.232	0,08	USD 325.000	Foundation Building Materials 6% 1/3/2029	275.120	0,02
USD 873.000	EnLink Midstream 6,5% 1/9/2030	877.171	0,05	USD 1.685.000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	1.444.357	0,08
USD 356.000	EnLink Midstream Partners 4,15% 1/6/2025	342.177	0,02	USD 893.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	813.757	0,05
USD 193.000	EnLink Midstream Partners 4,85% 15/7/2026	185.459	0,01	USD 4.847.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	4.705.455	0,28
				USD 719.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	766.796	0,05
				USD 218.000	Gartner 4,5% 1/7/2028	203.589	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.715.000	Gates Global / Gates 6,25% 15/1/2026	1.703.653	0,10	USD 509.000	Hilton Domestic Operating 4,875% 15/1/2030	475.145	0,03
USD 531.000	GCI 4,75% 15/10/2028	461.240	0,02	USD 61.000	Hilton Domestic Operating 5,375% 1/5/2025	60.626	0,00
USD 356.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 6,5% 1/10/2025	350.997	0,02	USD 369.000	Hilton Domestic Operating 5,75% 1/5/2028	362.357	0,02
USD 254.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7,75% 1/2/2028	247.855	0,02	USD 183.000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4,875% 1/4/2027	176.741	0,01
USD 543.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8,875% 15/4/2030	540.656	0,03	USD 4.426.000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	4.149.815	0,25
USD 1.362.000	Global Payments 5,4% 15/8/2032	1.333.457	0,08	USD 608.000	Howard Hughes 4,125% 1/2/2029	500.676	0,03
USD 800.000	GLP Capital / GLP Financing II 3,25% 15/1/2032	645.279	0,04	USD 296.000	Howard Hughes 4,375% 1/2/2031	235.619	0,01
USD 476.000	Go Daddy Operating / GD Finance 3,5% 1/3/2029	410.052	0,02	USD 243.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	219.447	0,01
USD 415.000	Go Daddy Operating / GD Finance 5,25% 1/12/2027	396.711	0,02	USD 876.000	Howard Midstream Energy Partners 8,875% 15/7/2028	901.185	0,05
USD 533.000	Goodyear Tire & Rubber 5% 15/7/2029	473.274	0,03	USD 17.000	Howmet Aerospace 5,125% 1/10/2024	16.841	0,00
USD 47.000	Goodyear Tire & Rubber 5,625% 30/4/2033	40.384	0,00	USD 3.360.000	HUB International 7% 1/5/2026	3.357.731	0,20
USD 543.000	Goodyear Tire & Rubber 9,5% 31/5/2025	555.189	0,03	USD 5.428.000	HUB International 7,25% 15/6/2030	5.501.554	0,33
USD 124.000	GrafTech Finance 4,625% 15/12/2028	97.336	0,01	USD 306.000	Hughes Satellite Systems 5,25% 1/8/2026	279.379	0,02
USD 1.166.000	GrafTech Global Enterprises 9,875% 15/12/2028*	1.131.463	0,07	USD 1.327.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4,375% 1/2/2029*	1.050.287	0,07
EUR 400.000	Graphic Packaging International 2,625% 1/2/2029	383.125	0,02	USD 506.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4,75% 15/9/2024	489.610	0,03
USD 220.000	Graphic Packaging International 3,5% 15/3/2028	196.306	0,01	USD 2.503.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5,25% 15/5/2027	2.194.063	0,13
USD 227.000	Graphic Packaging International 4,75% 15/7/2027	215.884	0,01	USD 661.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6,25% 15/5/2026	613.810	0,04
USD 513.000	Gray Television 5,875% 15/7/2026	469.945	0,03	USD 2.418.000	Illuminate Buyer / Illuminate IV 9% 1/7/2028*	2.240.943	0,13
USD 308.000	Gray Television 7% 15/5/2027	276.847	0,02	USD 1.842.000	Imola Merger 4,75% 15/5/2029	1.640.667	0,10
USD 536.000	GTCR AP Finance 8% 15/5/2027	530.831	0,03	USD 98.000	Ingevity 3,875% 1/11/2028	83.100	0,00
USD 123.500	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	125.530	0,01	USD 311.000	Installed Building Products 5,75% 1/2/2028	292.338	0,02
USD 1.464.000	GYP III 4,625% 1/5/2029	1.289.199	0,08	EUR 200.000	IQVIA 1,75% 15/3/2026	201.833	0,01
USD 92.000	H&E Equipment Services 3,875% 15/12/2028	80.547	0,01	EUR 100.000	IQVIA 2,25% 15/3/2029	93.344	0,01
USD 458.000	Hanesbrands 4,875% 15/5/2026*	428.938	0,03	USD 722.000	IQVIA 5% 15/10/2026	698.717	0,04
USD 1.102.000	Hanesbrands 9% 15/2/2031*	1.106.911	0,07	USD 655.000	IQVIA 5% 15/5/2027	629.778	0,04
USD 767.000	HAT I / HAT II 3,375% 15/6/2026	688.902	0,04	USD 516.000	IQVIA 6,5% 15/5/2030	519.246	0,03
USD 369.000	HB Fuller 4,25% 15/10/2028	329.722	0,02	USD 465.000	IRB 7% 15/6/2025*	465.419	0,03
USD 2.755.000	HealthEquity 4,5% 1/10/2029	2.445.093	0,14	USD 147.000	Iron Mountain 5,625% 15/7/2032	132.077	0,01
USD 355.000	HEICO 5,35% 1/8/2033	352.025	0,02	USD 2.194.000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	2.192.577	0,13
USD 400.000	Helios Software / ION Corporate Solutions Finance 4,625% 1/5/2028	345.413	0,02	USD 390.000	Iron Mountain Information Management Services 5% 15/7/2032	337.404	0,02
USD 1.777.000	Herc 5,5% 15/7/2027	1.711.585	0,10	USD 1.548.000	ITT 6,5% 1/8/2029	1.406.342	0,09
USD 603.000	Hertz 4,625% 1/12/2026	544.373	0,03	USD 1.251.000	Jefferies Finance / JFIN Co-Issuer 5% 15/8/2028	1.073.648	0,06
USD 325.000	Hertz 5% 1/12/2029	267.406	0,02	USD 668.000	JELD-WEN 4,625% 15/12/2025	647.045	0,04
USD 620.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5,75% 1/2/2029	575.732	0,04	USD 133.000	K Hovnanian Enterprises 7,75% 15/2/2026	131.758	0,01
USD 94.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6% 15/4/2030	87.334	0,01	USD 1.459.000	Kaiser Aluminum 4,5% 1/6/2031	1.178.904	0,07
USD 132.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6,25% 1/11/2028	127.196	0,01	USD 1.458.000	Kaiser Aluminum 4,625% 1/3/2028*	1.286.090	0,08
USD 13.000	Hilton Domestic Operating 3,625% 15/2/2032	10.813	0,00	USD 255.000	KB Home 7,25% 15/7/2030	257.180	0,02
USD 550.000	Hilton Domestic Operating 3,75% 1/5/2029	485.460	0,03	USD 370.000	Ken Garff Automotive 4,875% 15/9/2028	322.257	0,02
USD 1.147.000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	994.722	0,06	USD 1.575.000	Kinetik 5,875% 15/6/2030	1.524.844	0,09
				USD 1.208.000	Kobe US Midco 2 9,25% 1/11/2026	883.350	0,05

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 476.000	Kontoor Brands 4,125% 15/11/2029	404.233	0,02	USD 3.824.000	Live Nation Entertainment 6,5% 15/5/2027	3.829.331	0,23
USD 847.000	Korn Ferry 4,625% 15/12/2027	788.593	0,05	USD 624.000	LSF11 A5 HoldCo 6,625% 15/10/2029	521.052	0,03
EUR 1.984.000	Kronos International 3,75% 15/9/2025*	1.961.839	0,12	USD 1.556.000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	973.970	0,06
USD 889.000	LABL 5,875% 1/11/2028	805.562	0,05	USD 1.487.000	Madison IAQ 5,875% 30/6/2029	1.252.750	0,07
USD 1.658.000	LABL 9,5% 1/11/2028	1.708.803	0,10	USD 122.000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	118.361	0,01
USD 476.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,25% 1/2/2027	430.990	0,03	USD 70.000	MasTec 4,5% 15/8/2028	63.866	0,00
USD 280.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,75% 15/6/2029	235.608	0,01	USD 885.000	Matador Resources 5,875% 15/9/2026	863.702	0,05
USD 155.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5,25% 1/10/2025	149.350	0,01	USD 949.000	Matador Resources 6,875% 15/4/2028	950.155	0,06
USD 1.335.000	Lamb Weston 4,125% 31/1/2030	1.177.031	0,07	USD 755.000	Match II 3,625% 1/10/2031	614.117	0,04
USD 1.090.000	Lamb Weston 4,375% 31/1/2032	944.159	0,06	USD 97.000	Match II 4,125% 1/8/2030	83.290	0,00
USD 59.000	Lamb Weston 4,875% 15/5/2028	55.808	0,00	USD 318.000	Match II 4,625% 1/6/2028	293.272	0,02
USD 1.320.000	LCM Investments II 4,875% 1/5/2029	1.146.778	0,07	USD 27.000	Match II 5,625% 15/2/2029	25.481	0,00
USD 840.000	LCM Investments II 8,25% 1/8/2031	841.201	0,05	USD 796.000	Mattel 5,45% 1/11/2041	686.232	0,04
USD 622.000	Legacy LifePoint Health 4,375% 15/2/2027	538.030	0,03	USD 896.000	Mattel 6,2% 1/10/2040	837.839	0,05
EUR 3.175.926	Lehman Brothers 4,75% 16/1/2014***	17.918	0,00	USD 10.265.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	10.096.973	0,61
EUR 537.204	Lehman Brothers 5,375% 17/10/2012***	3.031	0,00	USD 310.000	Mauser Packaging Solutions 9,25% 15/4/2027	281.475	0,01
EUR 1.070.216	Lehman Brothers 6,375% 10/5/2011***	6.038	0,00	USD 3.478.000	McAfee 7,375% 15/2/2030	3.046.666	0,19
USD 3.170.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	2.902.329	0,17	USD 1.926.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	1.678.449	0,10
USD 326.000	Level 3 Financing 3,625% 15/1/2029	194.375	0,01	USD 4.990.000	Medline Borrower 5,25% 1/10/2029	4.443.416	0,26
USD 3.429.000	Level 3 Financing 4,625% 15/9/2027	2.583.033	0,15	USD 1.934.000	MercadoLibre 2,375% 14/1/2026*	1.769.349	0,11
USD 4.202.000	Level 3 Financing 10,5% 15/5/2030	4.270.726	0,26	USD 4.222.000	MercadoLibre 3,125% 14/1/2031	3.359.234	0,20
USD 505.000	Levi Strauss 3,5% 1/3/2031	409.599	0,02	USD 676.000	Metis Merger Sub 6,5% 15/5/2029*	588.488	0,03
EUR 2.778.000	Liberty Mutual 3,625% 23/5/2059	2.876.962	0,17	USD 205.000	MGIC Investment 5,25% 15/8/2028	195.659	0,01
USD 1.334.000	Life Time 5,75% 15/1/2026	1.302.189	0,08	USD 831.000	MGM Resorts International 5,75% 15/6/2025	820.977	0,05
USD 1.078.000	Life Time 8% 15/4/2026	1.076.868	0,07	USD 2.104.000	MicroStrategy 6,125% 15/6/2028	1.884.912	0,11
USD 1.144.000	LifePoint Health 9,875% 15/8/2030	1.129.239	0,07	USD 453.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance 5,375% 15/8/2027	427.958	0,03
USD 440.000	Light & Wonder International 7% 15/5/2028	439.235	0,03	USD 640.000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4,875% 1/5/2029	557.391	0,03
USD 373.000	Light & Wonder International 7,25% 15/11/2029	373.802	0,02	USD 1.088.003	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6,5% 20/6/2027	1.085.029	0,07
USD 619.000	Light & Wonder International 7,5% 1/9/2031	627.590	0,04	USD 717.000	Minerals Technologies 5% 1/7/2028	655.886	0,04
USD 1.247.000	Lindblad Expeditions 6,75% 15/2/2027	1.209.104	0,07	USD 1.171.000	ModivCare 5,875% 15/11/2025	1.112.286	0,07
USD 854.000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	878.305	0,05	USD 278.000	Molina Healthcare 3,875% 15/11/2030	237.780	0,01
USD 1.093.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	661.543	0,04	USD 850.000	Molina Healthcare 3,875% 15/5/2032	705.207	0,04
USD 544.000	Lithia Motors 3,875% 1/6/2029	467.651	0,03	USD 517.000	Molina Healthcare 4,375% 15/6/2028	476.061	0,03
USD 1.228.000	Live Nation Entertainment 3,75% 15/1/2028	1.096.430	0,07	GBP 1.042.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2,5% 24/3/2026	1.038.016	0,06
USD 1.484.000	Live Nation Entertainment 4,75% 15/10/2027	1.378.393	0,09	GBP 351.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2,55% 5/12/2023	430.460	0,03
USD 113.000	Live Nation Entertainment 4,875% 1/11/2024	111.077	0,01	USD 3.471.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 3,5% 15/3/2031	2.252.502	0,13
USD 60.000	Live Nation Entertainment 5,625% 15/3/2026	58.248	0,00	USD 764.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4,625% 1/8/2029	553.484	0,03
				USD 67.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5,25% 1/8/2026	57.021	0,00
				USD 469.000	MSCI 3,25% 15/8/2033	377.671	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 301.000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	265.902	0,02	USD 296.000	OneMain Finance 3,5% 15/1/2027	256.720	0,02
USD 20.000	Murphy Oil 5,75% 15/8/2025	19.809	0,00	USD 1.010.000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	787.613	0,05
USD 245.000	Murphy Oil 5,875% 1/12/2027	241.051	0,01	USD 520.000	OneMain Finance 5,375% 15/11/2029	452.368	0,03
USD 84.000	Murphy Oil 5,875% 1/12/2042	70.854	0,00	USD 828.000	OneMain Finance 6,625% 15/1/2028	775.954	0,04
USD 1.731.000	Nabors Industries 5,75% 1/2/2025	1.699.141	0,10	USD 768.000	OneMain Finance 6,875% 15/3/2025	764.971	0,05
USD 1.213.000	Nabors Industries 7,375% 15/5/2027	1.187.224	0,07	USD 1.315.000	OneMain Finance 7,125% 15/3/2026	1.296.196	0,08
USD 565.000	Nationstar Mortgage 5,125% 15/12/2030	477.322	0,03	USD 181.000	OneMain Finance 9% 15/1/2029	183.566	0,01
USD 54.000	Nationstar Mortgage 5,75% 15/11/2031	46.363	0,00	USD 356.000	Option Care Health 4,375% 31/10/2029	313.591	0,02
USD 576.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	549.164	0,03	EUR 1.168.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2,875% 30/4/2028	1.127.632	0,07
USD 345.000	Navient 5,5% 15/3/2029	295.323	0,02	USD 1.478.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4,125% 30/4/2028	1.337.909	0,08
USD 263.000	Navient 5,875% 25/10/2024*	259.343	0,02	USD 1.616.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5,125% 30/4/2031	1.378.304	0,08
USD 674.000	Navient 6,125% 25/3/2024	671.340	0,04	USD 556.000	OT Merger 7,875% 15/10/2029	368.453	0,02
USD 517.000	Navient 9,375% 25/7/2030	518.494	0,03	USD 1.691.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,25% 15/1/2029	1.388.766	0,09
USD 527.000	NCR 5% 1/10/2028	483.990	0,03	USD 195.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	158.681	0,01
USD 76.000	NCR 5,125% 15/4/2029	69.118	0,00	USD 1.912.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	1.732.368	0,10
USD 356.000	NCR 6,125% 1/9/2029	366.574	0,02	USD 132.000	Owens-Brockway Glass Container 6,625% 13/5/2027	130.781	0,01
USD 1.025.000	Neptune Bidco US 9,29% 15/4/2029	955.723	0,06	USD 791.000	Owens-Brockway Glass Container 7,25% 15/5/2031	795.310	0,05
USD 1.036.000	NESCO II 5,5% 15/4/2029	941.740	0,06	USD 830.000	Pacific Gas and Electric 6,1% 15/1/2029	819.983	0,05
USD 510.000	New Enterprise Stone & Lime 5,25% 15/7/2028	471.009	0,03	USD 1.215.000	Pacific Gas and Electric 6,4% 15/6/2033	1.202.565	0,07
USD 444.000	New Enterprise Stone & Lime 9,75% 15/7/2028	440.578	0,03	USD 256.000	Pacific Gas and Electric 6,75% 15/1/2053	248.864	0,02
USD 1.000.000	New Fortress Energy 6,5% 30/9/2026	930.024	0,06	USD 850.000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4,5% 15/8/2028	776.158	0,05
USD 3.684.000	New Fortress Energy 6,75% 15/9/2025	3.564.805	0,21	USD 433.000	PBF / PBF Finance 7,875% 15/9/2030	432.344	0,03
USD 744.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/7/2024	730.722	0,04	USD 114.000	PDC Energy 5,75% 15/5/2026	113.929	0,01
USD 4.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/9/2024	3.842	0,00	USD 483.000	Penske Automotive 3,5% 1/9/2025	461.328	0,03
USD 2.164.000	NFP 4,875% 15/8/2028	1.933.990	0,12	USD 250.000	Periama 5,95% 19/4/2026	238.440	0,01
USD 6.970.000	NFP 6,875% 15/8/2028	6.141.846	0,37	USD 128.000	Permian Resources Operating 5,375% 15/1/2026	124.019	0,01
USD 384.000	NFP 7,5% 1/10/2030	373.602	0,02	USD 2.177.000	Permian Resources Operating 5,875% 1/7/2029	2.106.801	0,13
USD 1.082.000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7,5% 1/2/2026	1.075.131	0,06	USD 635.000	Permian Resources Operating 6,875% 1/4/2027	631.473	0,04
USD 292.000	Nine Energy Service 13% 1/2/2028	265.275	0,02	USD 1.834.000	Permian Resources Operating 7,75% 15/2/2026	1.854.687	0,12
USD 200.000	Nissan Motor Acceptance 2,45% 15/9/2028	162.835	0,01	USD 373.000	PetSmart / PetSmart Finance 4,75% 15/2/2028	335.027	0,02
USD 1.075.000	Noble Finance II 8% 15/4/2030*	1.112.784	0,07	USD 2.034.000	PetSmart / PetSmart Finance 7,75% 15/2/2029	1.944.383	0,12
USD 770.000	Northern Trust 6,125% 2/11/2032	785.493	0,05	USD 44.000	Post 4,5% 15/9/2031	37.843	0,00
USD 1.179.000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4,75% 30/4/2027	1.029.060	0,06	USD 24.000	Post 4,625% 15/4/2030	21.283	0,00
USD 2.881.000	Novelis 3,25% 15/11/2026	2.614.783	0,16	USD 351.000	Post 5,5% 15/12/2029	325.913	0,02
USD 2.052.000	Novelis 3,875% 15/8/2031	1.701.215	0,10	USD 5.000	Post 5,75% 1/3/2027	4.893	0,00
USD 2.523.000	Novelis 4,75% 30/1/2030	2.263.656	0,14	USD 1.487.000	PRA Health Sciences 2,875% 15/7/2026	1.353.830	0,08
USD 620.000	NRG Energy 7% 15/3/2033	612.547	0,04				
USD 1.761.000	NuStar Logistics 5,75% 1/10/2025	1.728.009	0,10				
USD 324.000	NuStar Logistics 6% 1/6/2026	318.021	0,02				
USD 81.000	NuStar Logistics 6,375% 1/10/2030	78.040	0,01				
USD 873.000	Occidental Petroleum 6,2% 15/3/2040	860.686	0,05				
USD 102.000	Occidental Petroleum 6,45% 15/9/2036	104.089	0,01				
EUR 2.099.000	Olympus Water US 9,625% 15/11/2028*	2.281.228	0,14				
USD 2.270.000	Olympus Water US 9,75% 15/11/2028	2.288.709	0,14				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 531.000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5,625% 1/9/2029	415.014	0,03	USD 2.263.000	SBA Communications 3,125% 1/2/2029	1.936.031	0,12
USD 511.000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5,875% 1/9/2031	385.754	0,02	USD 2.107.000	SBA Communications 3,875% 15/2/2027	1.950.937	0,12
USD 170.000	Presidio 4,875% 1/2/2027	158.991	0,01	USD 375.000	Science Applications International 4,875% 1/4/2028	345.620	0,02
USD 350.000	Prestige Brands 3,75% 1/4/2031	289.940	0,02	USD 394.000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6,625% 1/3/2030	347.666	0,02
USD 428.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5,75% 15/4/2026	420.566	0,02	EUR 499.000	SCIL IV / SCIL USA 8,1% 1/11/2026	540.816	0,03
USD 1.974.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6,25% 15/1/2028	1.887.712	0,11	EUR 1.102.000	SCIL IV / SCIL USA 9,5% 15/7/2028	1.216.897	0,07
USD 244.000	PTC 3,625% 15/2/2025	236.007	0,01	USD 160.000	Scotts Miracle-Gro 4% 1/4/2031	126.750	0,01
USD 67.000	PTC 4% 15/2/2028	61.475	0,00	USD 122.000	Scotts Miracle-Gro 4,375% 1/2/2032	95.906	0,01
USD 1.501.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4,5% 15/9/2026	1.172.573	0,07	USD 191.000	Sealed Air 5% 15/4/2029	177.098	0,01
USD 3.384.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6,5% 15/9/2028	1.831.117	0,11	USD 82.000	Sealed Air 5,125% 1/12/2024*	80.948	0,00
USD 757.000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4,875% 1/11/2026	710.348	0,04	USD 632.000	Sealed Air/Sealed Air US 6,125% 1/2/2028	624.159	0,04
USD 29.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,25% 15/4/2030	20.418	0,00	USD 1.226.000	Sensata Technologies 4,375% 15/2/2030	1.085.229	0,07
USD 45.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,75% 15/1/2029	32.619	0,00	USD 246.000	Service International 3,375% 15/8/2030	204.807	0,01
USD 2.100.000	Regal Rexnord 6,05% 15/4/2028	2.078.905	0,12	USD 1.603.000	Service International 4% 15/5/2031	1.360.578	0,08
USD 685.000	Regal Rexnord 6,3% 15/2/2030	681.894	0,04	USD 97.000	Service International 5,125% 1/6/2029	91.544	0,01
USD 715.000	Regal Rexnord 6,4% 15/4/2033	708.641	0,04	USD 2.265.000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4,625% 1/11/2026	2.119.859	0,13
USD 284.000	RegionalCare Hospital Partners / LifePoint Health 9,75% 1/12/2026	264.911	0,02	USD 2.328.000	SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	1.759.176	0,11
USD 217.000	Resideo Funding 4% 1/9/2029	181.674	0,01	USD 774.000	Simmons Foods/Simmons Prepared Foods/Simmons Pet Food 4,625% 1/3/2029	643.205	0,04
USD 1.539.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,5% 15/2/2029	1.347.751	0,08	USD 2.693.000	Sinclair Television 4,125% 1/12/2030	1.737.505	0,10
USD 1.206.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	1.119.738	0,07	USD 865.000	Sirius XM Radio 3,125% 1/9/2026	776.957	0,05
USD 1.116.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 7,25% 15/7/2028	1.122.584	0,07	USD 2.529.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	2.335.304	0,14
USD 260.000	Ritchie Bros 6,75% 15/3/2028	262.100	0,02	USD 2.160.000	Six Flags Entertainment 7,25% 15/5/2031	2.076.896	0,13
USD 616.000	RLJ Lodging Trust 3,75% 1/7/2026	564.964	0,03	USD 1.259.000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	1.259.815	0,08
USD 460.000	RLJ Lodging Trust 4% 15/9/2029	385.227	0,02	USD 813.000	SLM 3,125% 2/11/2026	724.342	0,04
USD 1.084.000	Rockcliff Energy II 5,5% 15/10/2029	999.408	0,06	USD 1.421.000	SM Energy 5,625% 1/6/2025	1.399.626	0,08
USD 3.980.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	3.541.205	0,21	USD 640.000	SM Energy 6,5% 15/7/2028	624.576	0,04
USD 159.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,875% 1/3/2031	128.977	0,01	USD 89.000	SM Energy 6,625% 15/1/2027	88.343	0,01
USD 337.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 4% 15/10/2033	266.505	0,02	USD 690.000	SM Energy 6,75% 15/9/2026	686.847	0,04
USD 218.000	Rockies Express Pipeline 4,95% 15/7/2029	199.968	0,01	USD 2.662.000	Smyrna Ready Mix Concrete 6% 1/11/2028	2.555.223	0,16
USD 695.000	Ryan Specialty 4,375% 1/2/2030	622.415	0,04	USD 3.679.000	Sotheby's 7,375% 15/10/2027*	3.350.758	0,20
USD 1.235.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	1.215.130	0,08	USD 2.033.000	Sotheby's/Bidfair 5,875% 1/6/2029	1.572.369	0,09
USD 150.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	147.918	0,01	USD 4.000	Southwestern Energy 4,75% 1/2/2032	3.552	0,00
USD 508.000	Sasol Financing USA 4,375% 18/9/2026	455.247	0,03	USD 1.860.000	Southwestern Energy 5,375% 1/2/2029	1.767.495	0,10
USD 1.402.000	Sasol Financing USA 5,5% 18/3/2031	1.124.320	0,07	USD 55.000	Southwestern Energy 5,7% 23/1/2025	54.467	0,00
USD 2.128.000	Sasol Financing USA 5,875% 27/3/2024*	2.105.347	0,13	USD 595.000	Spectrum Brands 5% 1/10/2029	544.631	0,03
USD 1.080.000	Sasol Financing USA 8,75% 3/5/2029*	1.059.750	0,06	USD 2.383.000	SRS Distribution 4,625% 1/7/2028	2.125.651	0,12
				USD 2.261.000	SRS Distribution 6% 1/12/2029	1.935.574	0,12
				USD 1.880.000	SRS Distribution 6,125% 1/7/2029	1.635.708	0,10
				USD 3.245.000	SS&C Technologies 5,5% 30/9/2027	3.130.212	0,19
				USD 441.000	Stagwell Global 5,625% 15/8/2029	368.916	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 317.000	Standard Industries 2,25% 21/11/2026	304.832	0,02	USD 1.606.000	Tenet Healthcare 4,875% 1/1/2026	1.558.069	0,09
USD 373.000	Standard Industries 3,375% 15/1/2031	296.652	0,02	USD 503.000	Tenet Healthcare 5,125% 1/11/2027	479.514	0,03
USD 1.389.000	Standard Industries 4,375% 15/7/2030	1.183.983	0,07	USD 361.000	Tenet Healthcare 6,125% 1/10/2028	347.883	0,02
USD 143.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	131.828	0,01	USD 739.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	716.648	0,04
USD 476.000	Standard Industries 5% 15/2/2027	452.842	0,03	USD 752.000	Tenet Healthcare 6,25% 1/2/2027	741.819	0,04
USD 753.000	Staples 7,5% 15/4/2026	624.770	0,04	USD 4.039.000	Tenet Healthcare 6,75% 15/5/2031	4.029.815	0,24
USD 157.000	Starwood Property Trust 4,375% 15/1/2027	140.842	0,01	USD 594.000	Tenneco 8% 17/11/2028	488.779	0,03
USD 656.000	Starwood Property Trust 5,5% 1/11/2023	653.853	0,04	USD 2.219.000	Terex 5% 15/5/2029	2.039.427	0,12
USD 463.000	Station Casinos 4,5% 15/2/2028	414.365	0,03	USD 272.000	Titan International 7% 30/4/2028	259.262	0,02
USD 686.000	Station Casinos 4,625% 1/12/2031	563.001	0,03	USD 5.491.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	5.173.255	0,31
USD 157.000	Stericycle 3,875% 15/1/2029	137.118	0,01	USD 37.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	35.279	0,00
USD 3.533.000	Stillwater Mining 4,5% 16/11/2029*	2.794.126	0,17	USD 163.000	Tri Pointe Homes 5,7% 15/6/2028	154.240	0,01
USD 401.000	Suburban Propane Partners/ Suburban Energy Finance 5% 1/6/2031	343.372	0,02	USD 361.000	Trident TPI 12,75% 31/12/2028	375.979	0,02
USD 162.000	Summit Materials / Summit Materials Finance 5,25% 15/1/2029	150.659	0,01	USD 3.630.000	Triumph 9% 15/3/2028	3.643.874	0,22
USD 56.000	Sunoco / Sunoco Finance 6% 15/4/2027	55.462	0,00	USD 524.000	TTMT Escrow Issuer 8,625% 30/9/2027	540.686	0,03
USD 886.000	Surgery Center 6,75% 1/7/2025*	886.040	0,05	USD 480.000	Twilio 3,625% 15/3/2029	412.623	0,02
USD 1.404.000	Surgery Center 10% 15/4/2027	1.429.904	0,09	USD 1.845.000	Twilio 3,875% 15/3/2031	1.551.842	0,09
USD 1.642.000	SWF Escrow Issuer 6,5% 1/10/2029	1.059.534	0,06	USD 1.647.000	Uber Technologies 0% 15/12/2025	1.541.829	0,09
USD 1.154.000	Synaptics 4% 15/6/2029	978.270	0,06	USD 2.972.000	Uber Technologies 4,5% 15/8/2029	2.728.442	0,17
USD 460.000	Talen Energy Supply 8,625% 1/6/2030	478.994	0,03	USD 501.000	Uber Technologies 6,25% 15/1/2028	496.494	0,03
USD 121.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5,5% 15/1/2028	112.223	0,01	USD 1.062.000	Uber Technologies 7,5% 15/5/2025	1.072.425	0,06
USD 175.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	167.469	0,01	USD 2.775.000	Uber Technologies 7,5% 15/9/2027	2.828.652	0,17
USD 120.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 31/12/2030	107.628	0,01	USD 2.025.000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	2.063.341	0,12
USD 553.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/9/2031	488.714	0,03	EUR 1.422.000	UGI International 2,5% 1/12/2029*	1.206.973	0,07
USD 47.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7,5% 1/10/2025	47.116	0,00	USD 1.977.000	United Airlines 4,375% 15/4/2026	1.862.632	0,11
USD 369.000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 4% 15/1/2032	318.707	0,02	USD 1.893.000	United Airlines 4,625% 15/4/2029	1.685.560	0,10
USD 78.000	Taylor Morrison Communities 5,125% 1/8/2030	71.657	0,00	USD 1.603.975	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027	1.601.884	0,09
USD 906.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	891.096	0,05	USD 132.533	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026	127.563	0,01
USD 151.000	TEGNA 4,75% 15/3/2026	144.001	0,01	USD 265.000	United Natural Foods 6,75% 15/10/2028	220.885	0,02
USD 127.000	Teleflex 4,625% 15/11/2027	119.230	0,01	USD 5.943.000	United Rentals North America 6% 15/12/2029	5.913.391	0,36
USD 335.000	Tempo Acquisition / Tempo Acquisition Finance 5,75% 1/6/2025	329.643	0,02	USD 3.295.000	United States Treasury Bill 0% 21/11/2023	3.255.781	0,20
USD 677.000	Tempur Sealy International 3,875% 15/10/2031	545.080	0,03	USD 2.494.000	Unifi Group / Unifi Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	2.485.777	0,15
USD 261.000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029*	225.113	0,01	USD 46.000	Univision Communications 5,125% 15/2/2025*	45.257	0,00
USD 147.000	Tenet Healthcare 4,625% 15/6/2028	135.474	0,01	USD 94.000	Univision Communications 6,625% 1/6/2027	91.280	0,01
				USD 676.000	Univision Communications 7,375% 30/6/2030*	657.049	0,04
				USD 1.127.000	Univision Communications 8% 15/8/2028	1.128.666	0,07
				USD 144.000	US Foods 4,625% 1/6/2030	128.066	0,01
				USD 1.936.000	US Foods 4,75% 15/2/2029	1.766.465	0,11
				USD 376.000	US Foods 6,25% 15/4/2025	377.070	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.081.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/4/2026	2.061.055	0,12	USD 561.000	WR Grace 7,375% 1/3/2031	554.389	0,03
USD 2.082.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/9/2027	2.032.079	0,12	USD 156.000	Wyndham Hotels & Resorts 4,375% 15/8/2028	142.831	0,01
USD 393.000	Vail Resorts 6,25% 15/5/2025	392.097	0,02	USD 1.001.000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5,25% 15/5/2027	947.235	0,06
USD 2.590.000	Venture Global Calcasieu Pass 3,875% 15/8/2029	2.242.527	0,14	USD 3.135.000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5,125% 1/10/2029	2.809.726	0,17
USD 2.342.000	Venture Global Calcasieu Pass 3,875% 1/11/2033	1.903.542	0,11	USD 1.167.000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7,125% 15/2/2031	1.146.322	0,07
USD 2.049.000	Venture Global Calcasieu Pass 4,125% 15/8/2031	1.740.035	0,10	USD 280.000	XPO Escrow Sub 7,5% 15/11/2027	284.992	0,02
USD 4.490.000	Venture Global LNG 8,125% 1/6/2028	4.525.350	0,27	USD 12.087.000	Zayo 4% 1/3/2027*	9.089.515	0,55
USD 6.872.000	Venture Global LNG 8,375% 1/6/2031	6.933.951	0,42	USD 3.284.000	Zayo 6,125% 1/3/2028	2.136.348	0,13
USD 2.180.000	Veritas US / Veritas Bermuda 7,5% 1/9/2025	1.789.792	0,11	USD 2.937.000	ZoomInfo Technologies/ ZoomInfo Finance 3,875% 1/2/2029	2.499.303	0,15
USD 6.875.000	Verscend Escrow 9,75% 15/8/2026	6.837.892	0,41			843.902.404	50,74
USD 2.899.000	Vertiv 4,125% 15/11/2028	2.605.542	0,16		Total des obligations	1.594.204.633	95,81
USD 840.000	Viavi Solutions 3,75% 1/10/2029	700.552	0,04		Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	1.602.945.960	96,33
USD 732.000	VICI Properties 4,95% 15/2/2030	689.204	0,04				
USD 818.000	VICI Properties 5,625% 15/5/2052	720.640	0,04		Autres titres négociables		
USD 174.000	VICI Properties / VICI Note 3,875% 15/2/2029	153.163	0,01		ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES		
USD 857.000	VICI Properties / VICI Note 4,125% 15/8/2030	750.722	0,04		Luxembourg		
USD 365.000	VICI Properties / VICI Note 4,5% 15/1/2028	339.043	0,02	45.081	ADLER**	24.455	0,00
USD 2.004.000	VICI Properties / VICI Note 4,625% 1/12/2029	1.809.908	0,11		Royaume-Uni		
USD 951.000	Wabash National 4,5% 15/10/2028	807.211	0,05	6.177	New Topco**	-	0,00
USD 1.740.000	Warnermedia 5,141% 15/3/2052	1.389.401	0,08		États-Unis		
USD 1.102.000	Warnermedia 5,391% 15/3/2062	875.460	0,05	881	Alliant**	835.268	0,05
USD 4.036.000	Waste Pro USA 5,5% 15/2/2026	3.808.491	0,23	130.287	AMP PIPE**	465.125	0,03
USD 1.108.000	Wells Fargo 5,557% 25/7/2034	1.094.396	0,07	568	Verscend Intermediate**	744.863	0,05
USD 1.838.000	WESCO Distribution 7,125% 15/6/2025	1.847.550	0,11			2.045.256	0,13
USD 1.807.000	WESCO Distribution 7,25% 15/6/2028	1.834.351	0,11		Total des actions ordinaires et privilégiées	2.069.711	0,13
USD 2.090.000	Western Midstream Operating 5,25% 1/2/2050	1.696.662	0,10		OBLIGATIONS		
USD 851.000	Western Midstream Operating 5,3% 1/3/2048	698.060	0,04		Bermudes		
USD 677.000	Western Midstream Operating 5,45% 1/4/2044	569.008	0,03	USD 2.830.186	DGL2 8,25% 30/9/2022****	-	0,00
USD 150.000	Western Midstream Operating 5,5% 15/8/2048	124.434	0,01		Inde		
USD 6.075.000	White Cap Buyer 6,875% 15/10/2028	5.574.754	0,34	USD 386.831	Videocon Industries 2,8% 31/12/2020****	-	0,00
USD 869.000	White Cap Parent 8,25% 15/3/2026	852.069	0,05		États-Unis		
USD 952.000	Williams Scotsman International 4,625% 15/8/2028	866.446	0,05	USD 100.000	Tropicana Entertainment / Tropicana Finance 9,625% 15/12/2014****	-	0,00
USD 752.000	Williams Scotsman International 6,125% 15/6/2025	745.749	0,04	EUR 13.830.000	WinStar Communications 12,75% 15/4/2010****	-	0,00
USD 1.343.000	WR Grace 4,875% 15/6/2027	1.254.215	0,08			-	0,00
USD 4.003.000	WR Grace 5,625% 15/8/2029	3.368.805	0,20		Total des obligations	-	0,00
					Total des autres valeurs mobilières	2.069.711	0,13
					Total du portefeuille	1.605.015.671	96,46
					Autres éléments de l'actif net	58.894.915	3,54
					Total de l'actif net (USD)	1.663.910.586	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	12.769	USD	13.985	Citigroup	20/9/2023	(120)
EUR	260.699	USD	286.511	JP Morgan	5/9/2023	(3.653)
EUR	2.418.000	USD	2.656.567	HSBC Bank	5/9/2023	(33.043)
EUR	950.653	USD	1.027.908	Citigroup	5/9/2023	3.548
USD	951.170	EUR	882.000	RBS	20/9/2023	(6.492)
USD	602.488	GBP	468.000	Morgan Stanley	5/9/2023	9.225
USD	57.400.059	GBP	44.588.000	Citibank	5/9/2023	877.823
USD	9.117.646	EUR	8.258.000	Deutsche Bank	5/9/2023	157.735
USD	1.239.940	GBP	963.545	JP Morgan	5/9/2023	18.496
USD	334.685.222	EUR	303.158.226	JP Morgan	5/9/2023	5.759.224
USD	127.996	GBP	100.000	BNY Mellon	5/9/2023	1.230
USD	1.854.055	EUR	1.692.000	Barclays	5/9/2023	18.239
USD	3.352.543	EUR	3.063.000	HSBC Bank	5/9/2023	29.196
USD	1.911.887	GBP	1.501.000	Citigroup	5/9/2023	9.135
USD	762.564	GBP	601.000	HSBC Bank	5/9/2023	703
USD	262.930	EUR	240.000	Bank of America	5/9/2023	2.531
USD	182.088	GBP	143.000	BNP Paribas	5/9/2023	813
USD	416.034	GBP	328.000	State Street	5/9/2023	243
USD	1.463.176	EUR	1.341.000	Citigroup	5/9/2023	8.195
USD	1.456.080	GBP	1.148.000	Morgan Stanley	3/10/2023	626
USD	59.955.943	GBP	47.272.000	HSBC Bank	3/10/2023	23.686
USD	342.648.011	EUR	312.816.000	JP Morgan	3/10/2023	2.783.093
Plus-value nette non réalisée						9.660.433
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	40.805.020	USD	26.575.932	BNY Mellon	15/9/2023	(133.656)
USD	118.355	AUD	183.141	BNY Mellon	15/9/2023	(322)
Moins-value nette non réalisée						(133.978)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	7.766	USD	5.775	BNY Mellon	15/9/2023	(34)
Moins-value nette non réalisée						(34)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	4.063	USD	4.652	BNY Mellon	15/9/2023	(46)
USD	33	CHF	29	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(46)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	3.108.114	USD	430.749	BNY Mellon	15/9/2023	(3.293)
USD	2.990	CNY	21.820	BNY Mellon	15/9/2023	(10)
Moins-value nette non réalisée						(3.303)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	413.157.021	USD	453.301.285	BNY Mellon	15/9/2023	(4.807.194)
USD	3.812.230	EUR	3.495.563	BNY Mellon	15/9/2023	17.707
Moins-value nette non réalisée						(4.789.487)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	27.048.698	USD	34.416.093	BNY Mellon	15/9/2023	(126.090)
USD	531.951	GBP	417.949	BNY Mellon	15/9/2023	2.112
Moins-value nette non réalisée						(123.978)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	62.123.680	USD	7.959.511	BNY Mellon	15/9/2023	(34.310)
USD	150.757	HKD	1.178.718	BNY Mellon	15/9/2023	387
Moins-value nette non réalisée						(33.923)

Global High Yield Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	32.900.450	USD	8.100.728	BNY Mellon	15/9/2023	(118.333)
USD	67.144	PLN	276.779	BNY Mellon	15/9/2023	(9)
Moins-value nette non réalisée						(118.342)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	34.126.068	USD	3.193.707	BNY Mellon	15/9/2023	(63.791)
USD	29.907	SEK	326.826	BNY Mellon	15/9/2023	(68)
Moins-value nette non réalisée						(63.859)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	8.143.649	USD	6.050.099	BNY Mellon	15/9/2023	(22.395)
USD	30.991	SGD	41.999	BNY Mellon	15/9/2023	(95)
Moins-value nette non réalisée						(22.490)
Catégorie d'Actions couverte en ZAR						
USD	162.495	ZAR	3.093.470	BNY Mellon	15/9/2023	(1.982)
ZAR	220.317.540	USD	11.681.656	BNY Mellon	15/9/2023	32.276
Plus-value nette non réalisée						30.294
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.363.226.952)						4.401.287

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(25)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	3.236.719	(43.272)
67	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	7.155.914	44.295
Total				10.392.633	1.023

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR (568.528)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2026	(6.667)	17.335
CDS	EUR (840.000)	Fund provides default protection on Tkagr; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/12/2023	27.678	1.747
CDS	EUR (680.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2026	49.349	20.734
CDS	EUR (868.735)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	823	(215.439)
CDS	EUR (764.014)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	82.028	(34.869)
CDS	EUR (872.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2026	63.480	39.378
CDS	EUR (552.624)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(7.835)	16.850
CDS	EUR (1.080.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes Finance; and receives Fixed 1%	Credit Suisse	20/12/2026	57.666	(15.899)
CDS	EUR (860.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	61.458	101.714
CDS	EUR (862.080)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2027	1.876	(213.789)
CDS	EUR (775.447)	Fund provides default protection on Elevator Holdcogmbh; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2026	(126)	33.068
CDS	EUR 737.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	1.700	157.653

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global High Yield Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR 737.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	HSBC Bank	20/6/2028	(507)	157.653
CDS	EUR (520.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2026	8.990	57.262
CDS	EUR (1.240.000)	Fund provides default protection on K And S 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2026	56.044	162.406
CDS	EUR (673.898)	Fund provides default protection on Ladbrokes Finance; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	103.867	(14.715)
CDS	EUR (196.667)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	17.938	(4.294)
CDS	EUR (393.333)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	35.877	(8.588)
CDS	EUR (166.102)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	21.349	(3.627)
CDS	EUR (725.986)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	85.848	(33.133)
CDS	EUR (617.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	19.642	(24.937)
CDS	EUR 441.092	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(2.607)	655
CDS	EUR 552.908	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(3.942)	821
CDS	EUR (440.000)	Fund provides default protection on Virgin Media Finance; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(32.126)	25.621
CDS	USD (45.698.217)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	1.151.132	1.352.124
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 63.190.654)					1.792.935	1.575.731

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
291	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/9/2023	(160.233)	7.130
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 436.088)						(160.233)	7.130

Global Inflation Linked Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				EUR 1.185.000	French Republic Government Bond OAT 3,15% 25/7/2032	2.406.351	0,89
				EUR 873.000	French Republic Government Bond OAT 3,4% 25/7/2029	1.639.758	0,61
COMPARTIMENTS							
Irlande							
1.005.365	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund [†]	1.005.365	0,37				
Total des Compartiments				25.981.005 9,61			
OBLIGATIONS							
Australie				Allemagne			
AUD 600.000	Australia Government Bond 0,25% 21/11/2032	388.770	0,14	EUR 2.155.000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,1% 15/4/2026*	2.852.889	1,05
AUD 835.000	Australia Government Bond 0,75% 21/11/2027	637.640	0,24	EUR 1.030.000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,1% 15/4/2033	1.312.592	0,49
AUD 480.000	Australia Government Bond 1,25% 21/8/2040	358.386	0,13	EUR 2.205.000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,5% 15/4/2030	3.035.472	1,12
AUD 460.000	Australia Government Bond 2% 21/8/2035	402.221	0,15	7.200.953 2,66			
AUD 630.000	Australia Government Bond 2,5% 20/9/2030	609.501	0,23	Italie			
AUD 1.065.000	Australia Government Bond 3% 20/9/2025	1.024.756	0,38	EUR 1.792.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,1% 15/5/2033	1.871.708	0,69
3.421.274 1,27				EUR 1.367.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,4% 15/5/2030	1.627.593	0,60
Canada				EUR 1.105.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,65% 15/5/2026	1.374.377	0,51
CAD 700.000	Canadian Government Real Return Bond 2% 1/12/2041	743.004	0,27	EUR 1.535.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,25% 15/9/2032	1.970.234	0,73
CAD 642.000	Canadian Government Real Return Bond 3% 1/12/2036	814.587	0,30	EUR 2.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,3% 15/5/2028	2.640.685	0,98
CAD 817.000	Canadian Government Real Return Bond 4% 1/12/2031	1.209.524	0,45	EUR 240.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,5% 15/5/2029	263.736	0,10
CAD 60.000	Canadian Government Real Return Bond 4,25% 1/12/2026	84.809	0,03	EUR 1.245.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 15/9/2024	1.686.216	0,62
2.851.924 1,05				EUR 1.375.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 15/9/2035	2.295.806	0,85
Danemark				EUR 1.620.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,55% 15/9/2041	2.522.861	0,93
DKK 3.525.000	Denmark I/L Government Bond 0,1% 15/11/2030	570.044	0,21	EUR 1.290.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,1% 15/9/2026	1.924.497	0,71
				18.177.713 6,72			
France				Japon			
EUR 1.325.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 1/3/2025	1.662.473	0,62	JPY 50.600.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,005% 10/3/2031	389.671	0,14
EUR 1.380.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 1/3/2026	1.732.633	0,64	JPY 104.700.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,005% 10/3/2032	796.217	0,30
EUR 1.725.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 1/3/2028	2.159.887	0,80	JPY 27.700.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,005% 10/3/2033	201.280	0,07
EUR 1.545.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 1/3/2029*	1.949.581	0,72	JPY 100.900.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,1% 10/9/2024	760.104	0,28
EUR 1.140.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 25/7/2031	1.414.456	0,52	JPY 184.100.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,1% 10/3/2025	1.400.346	0,52
EUR 860.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 1/3/2032	1.028.161	0,38	JPY 184.800.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,1% 10/3/2026	1.415.869	0,52
EUR 795.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 1/3/2036	912.225	0,34	JPY 149.400.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,1% 10/3/2027	1.155.900	0,43
EUR 1.225.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 25/7/2036	1.493.339	0,55	JPY 155.200.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,1% 10/3/2028	1.188.228	0,44
EUR 595.000	French Republic Government Bond OAT 0,1% 25/7/2038*	683.225	0,25	JPY 151.800.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,1% 10/3/2029	1.155.720	0,43
EUR 255.000	French Republic Government Bond OAT 0,55% 1/3/2039	281.937	0,11	JPY 50.400.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,2% 10/3/2030	394.828	0,15
EUR 1.845.000	French Republic Government Bond OAT 0,7% 25/7/2030	2.521.221	0,93	8.858.163 3,28			
EUR 1.370.000	French Republic Government Bond OAT 1,8% 25/7/2040	2.443.910	0,90	Nouvelle-Zélande			
EUR 2.425.000	French Republic Government Bond OAT 1,85% 25/7/2027	3.651.848	1,35	NZD 660.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2% 20/9/2025	499.355	0,19

[†] Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Inflation Linked Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
NZD 590.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,5% 20/9/2035	429.572	0,16	GBP 998.109	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 2% 26/1/2035	3.049.797	1,13
NZD 546.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,5% 20/9/2040	382.617	0,14	GBP 493.616	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 4,125% 22/7/2030	2.106.180	0,78
NZD 525.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3% 20/9/2030	406.039	0,15			40.854.795	15,11
		1.717.583	0,64		États-Unis		
	Espagne			USD 165.000	AT&T 3,5% 15/9/2053	108.628	0,04
EUR 1.560.000	Spain Government Bond 3,15% 30/4/2033	1.650.430	0,61	USD 125.000	Bank of America 3,97% 5/3/2029	116.709	0,05
EUR 1.580.000	Spain Government Inflation Linked Bond 0,65% 30/11/2027	2.080.234	0,77	USD 125.000	Broadcom 4,926% 15/5/2037	112.457	0,04
EUR 1.886.000	Spain Government Inflation Linked Bond 0,7% 30/11/2033	2.360.907	0,88	USD 180.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3,9% 1/6/2052	115.335	0,04
EUR 1.765.000	Spain Government Inflation Linked Bond 1% 30/11/2030	2.352.052	0,87	USD 145.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5,25% 1/4/2053	114.879	0,04
EUR 1.573.000	Spain Government Inflation Linked Bond 1,8% 30/11/2024	2.116.418	0,78	USD 135.000	Citigroup 2,976% 5/11/2030	115.968	0,04
		10.560.041	3,91	USD 130.000	Duke Energy 5% 15/8/2052	114.565	0,04
	Suède			USD 140.000	Goldman Sachs 3,102% 24/2/2033	116.654	0,05
SEK 2.755.000	Sweden Inflation Linked Bond 0,125% 1/6/2026	315.906	0,12	USD 85.000	Goldman Sachs 6,796% 15/5/2026	85.237	0,03
SEK 2.170.000	Sweden Inflation Linked Bond 0,125% 1/12/2027	243.376	0,09	USD 90.000	JPMorgan Chase 4,586% 26/4/2033	84.383	0,03
SEK 1.235.000	Sweden Inflation Linked Bond 0,125% 1/6/2030	127.807	0,05	USD 125.000	Kinder Morgan 5,45% 1/8/2052	111.674	0,04
SEK 3.205.000	Sweden Inflation Linked Bond 0,125% 1/6/2032	356.044	0,13	USD 125.000	Morgan Stanley 3,591% 22/7/2028	115.615	0,04
SEK 6.785.000	Sweden Inflation Linked Bond 1% 1/6/2025	797.290	0,29	USD 105.000	Morgan Stanley 6,342% 18/10/2033	110.180	0,04
SEK 3.755.000	Sweden Inflation Linked Bond 3,5% 1/12/2028	612.154	0,23	USD 125.000	Oracle 5,55% 6/2/2053	116.563	0,05
		2.452.577	0,91	USD 3.690.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/10/2024	4.240.216	1,57
	Royaume-Uni			USD 3.727.500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2025	4.196.556	1,55
GBP 1.460.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,125% 22/3/2026	2.611.622	0,96	USD 3.595.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/10/2025	4.010.484	1,48
GBP 1.740.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,125% 10/8/2028	2.873.314	1,06	USD 4.150.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2026	4.525.380	1,67
GBP 1.645.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,125% 22/3/2029	3.183.214	1,18	USD 3.860.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/7/2026	4.611.384	1,71
GBP 1.090.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,125% 10/8/2031	1.716.120	0,63	USD 4.055.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/10/2026*	4.231.233	1,57
GBP 1.485.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,125% 22/11/2036	2.480.805	0,92	USD 4.190.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2027	4.183.135	1,55
GBP 890.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,125% 22/3/2039	1.246.480	0,46	USD 4.380.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/1/2030	4.620.211	1,71
GBP 1.250.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,125% 10/8/2041	1.807.120	0,67	USD 4.500.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/7/2030	4.745.089	1,76
GBP 1.455.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,625% 22/3/2040	3.005.570	1,11	USD 4.545.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/1/2031	4.665.961	1,73
GBP 1.325.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,625% 22/11/2042	2.735.767	1,01	USD 4.845.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/7/2031	4.809.962	1,78
GBP 1.552.481	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,75% 22/3/2034	3.192.206	1,18	USD 5.260.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/1/2032	4.989.561	1,85
GBP 35.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0,75% 22/11/2047	72.730	0,03				
GBP 1.344.456	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 1,125% 22/11/2037	3.262.451	1,21				
GBP 1.520.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 1,25% 22/11/2027	3.789.334	1,40				
GBP 1.600.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 1,25% 22/11/2032	3.722.085	1,38				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Inflation Linked Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 4.300.100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,25% 15/1/2025	5.319.329	1,97	USD 1.445.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,75% 15/1/2028	2.066.292	0,76
USD 4.165.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,25% 15/7/2029	4.505.147	1,67	USD 1.965.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2% 15/1/2026	2.970.685	1,10
USD 4.300.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/7/2025	5.298.702	1,96	USD 1.595.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,125% 15/2/2040	2.309.156	0,85
USD 4.035.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/1/2027	4.767.785	1,76	USD 2.485.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,125% 15/2/2041†	3.552.530	1,31
USD 3.905.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,375% 15/7/2027	4.551.573	1,68	USD 2.935.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,375% 15/1/2025	4.693.667	1,74
USD 1.375.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,5% 15/1/2028	1.583.249	0,59	USD 1.830.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,375% 15/1/2027	2.767.450	1,02
USD 4.445.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/1/2026	5.439.142	2,01	USD 1.491.500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,5% 15/1/2029*	2.165.696	0,80
USD 5.100.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/7/2032	4.807.966	1,78	USD 530.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3,375% 15/4/2032	1.010.568	0,37
USD 2.415.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/2/2043	2.492.353	0,92	USD 1.742.100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3,625% 15/4/2028	3.497.052	1,29
USD 3.905.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,75% 15/7/2028	4.470.917	1,65	USD 1.990.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3,875% 15/4/2029	4.036.511	1,49
USD 2.430.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,75% 15/2/2042	2.658.116	0,98	USD 411.000	United States Treasury Note/ Bond 4,125% 15/8/2053	405.702	0,15
USD 3.791.900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,875% 15/1/2029*	4.310.370	1,60	USD 125.000	Verizon Communications 4,5% 10/8/2033	115.522	0,05
USD 5.115.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,125% 15/1/2033	4.886.154	1,81			145.544.221	53,86
USD 1.560.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,25% 15/4/2028	1.526.011	0,57		Total des obligations	268.190.293	99,23
USD 2.260.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,375% 15/7/2033	2.174.786	0,81		Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	269.195.658	99,60
USD 259.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	239.232	0,09		Total du portefeuille	269.195.658	99,60
USD 1.540.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,625% 15/10/2027	1.554.539	0,58		Autres éléments de l'actif net	1.090.756	0,40
					Total de l'actif net (USD)	270.286.414	100,00

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	97.539	USD	65.804	JP Morgan	5/9/2023	(2.621)
EUR	1.022.700	USD	1.120.128	Standard Chartered Bank	5/9/2023	(10.500)
EUR	872.161	USD	959.601	RBS	5/9/2023	(13.309)
EUR	297.691	USD	325.258	UBS	5/9/2023	(2.264)
GBP	1.107.396	USD	1.414.790	Morgan Stanley	5/9/2023	(10.993)
GBP	1.875.038	USD	2.386.084	Standard Chartered Bank	5/9/2023	(9.182)
GBP	254.771	USD	324.756	Barclays	5/9/2023	(1.794)
JPY	195.489.011	USD	1.427.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(86.023)
JPY	39.024.000	USD	268.774	Royal Bank of Canada	5/9/2023	(1.727)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Inflation Linked Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
SEK	1.752.000	USD	163.346	State Street	5/9/2023	(2.740)
USD	1.427.000	JPY	203.523.049	Deutsche Bank	20/9/2023	30.913
USD	65.941.828	EUR	59.767.000	Société Générale	5/9/2023	1.094.766
USD	9.209.483	JPY	1.285.688.000	UBS	5/9/2023	411.328
USD	589.627	DKK	3.982.000	State Street	5/9/2023	9.838
USD	2.695.944	SEK	28.229.000	State Street	5/9/2023	108.194
USD	45.748.061	GBP	35.554.000	Morgan Stanley	5/9/2023	677.828
USD	3.466.087	AUD	5.188.000	State Street	5/9/2023	105.427
USD	1.816.189	NZD	2.945.000	BNP Paribas	5/9/2023	64.647
USD	3.029.059	CAD	4.007.000	Deutsche Bank	5/9/2023	67.135
USD	138.711	JPY	19.612.000	Royal Bank of Canada	5/9/2023	4.503
USD	222.646	GBP	173.016	JP Morgan	5/9/2023	3.321
USD	97.433	AUD	145.000	Goldman Sachs	5/9/2023	3.506
USD	179.986	JPY	25.438.734	JP Morgan	5/9/2023	5.905
USD	180.102	EUR	163.086	JP Morgan	5/9/2023	3.154
USD	142.289	EUR	130.000	Citigroup	5/9/2023	1.240
USD	1.755.834	NZD	2.945.000	Goldman Sachs	3/10/2023	4.178
USD	2.438.736	SEK	26.477.000	Citigroup	3/10/2023	8.230
USD	582.911	DKK	3.982.000	Citigroup	3/10/2023	2.172
USD	3.386.966	AUD	5.221.000	State Street	3/10/2023	1.444
USD	41.101.238	GBP	32.405.000	State Street	3/10/2023	17.621
USD	63.097.463	EUR	57.604.000	JP Morgan	3/10/2023	512.497
USD	8.898.818	JPY	1.291.715.000	UBS	3/10/2023	19.748
USD	2.898.298	CAD	3.919.000	Royal Bank of Canada	3/10/2023	173
Plus-value nette non réalisée						3.016.615
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	189.760.840	USD	208.215.223	BNY Mellon	15/9/2023	(2.224.246)
USD	4.599.107	EUR	4.207.901	BNY Mellon	15/9/2023	31.317
Moins-value nette non réalisée						(2.192.929)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 474.488.062)						823.686

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(5)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	5.027.198	22.989
10	AUD	Australian 10 Year Bond	Septembre 2023	753.668	(4.049)
(30)	AUD	Australian 3 Year Bond	Septembre 2023	2.067.932	(7.631)
(11)	USD	30 Day Federal Funds	Octobre 2023	4.338.014	(503)
(2)	EUR	Euro BUXL	Décembre 2023	289.507	(2.213)
(7)	EUR	Euro-BTP	Décembre 2023	876.798	(5.295)
(6)	EUR	Euro-OAT	Décembre 2023	828.486	(6.379)
(14)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	1.701.875	(24.380)
(34)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	3.770.281	(28.156)
(15)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	1.739.766	(21.502)
(5)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	647.344	(8.879)
(47)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	9.572.578	1.664
17	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	1.815.680	11.150
11	USD	30 Day Federal Funds	Mars 2024	4.338.930	(2.518)
205	USD	3 Month SOFR	Juin 2024	48.567.063	(54.041)
29	USD	3 Month SOFR	Septembre 2024	6.892.213	(3.262)
Total				93.227.333	(133.005)

Global Inflation Linked Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IFS	USD 5.750.000	Fund receives default protection US CPIU + 0bps; and pays Fixed 2,6065%	Bank of America	12/12/2027	(15.866)	(15.866)
IFS	EUR 1.235.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,4085%	Bank of America	15/5/2028	8.273	8.274
IFS	USD 2.211.950	Fund receives default protection US CPIU + 0bps; and pays Fixed 2,414%	Bank of America	2/6/2028	6.301	6.301
IFS	EUR 1.235.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,4375%	Bank of America	15/5/2033	(13.198)	(13.198)
IFS	EUR 200.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,441%	Bank of America	15/8/2052	(25.780)	(25.780)
IFS	EUR 100.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,6045%	Bank of America	15/8/2052	7.771	7.771
IFS	EUR 100.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,6465%	Bank of America	15/11/2052	(4.811)	(4.811)
IFS	EUR 50.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,641%	Bank of America	15/3/2053	(1.708)	(1.708)
IFS	EUR 50.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,691%	Bank of America	15/3/2053	(902)	(902)
IFS	EUR 45.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,752%	Bank of America	15/5/2053	396	396
IFS	EUR 85.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,78%	Bank of America	15/8/2053	1.237	1.289
IFS	EUR 85.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,798%	Bank of America	15/8/2053	1.956	1.796
IFS	EUR 100.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,808%	Bank of America	15/8/2053	2.445	2.445
IFS	EUR 100.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,82%	Bank of America	15/8/2053	2.292	2.845
IFS	EUR 40.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,8592%	Bank of America	15/8/2053	(1.665)	(1.665)
IRS	USD 3.092.000	Fund receives Fixed 4,185%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	29/7/2025	(3.486)	(3.486)
IRS	EUR 2.735.500	Fund receives Floating EUR ESTR 1 Day; and pays Fixed 3,225%	Bank of America	29/7/2025	(3.113)	(3.113)
IRS	USD 12.798.720	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 4,7915%	Bank of America	4/8/2025	13.185	13.185
IRS	USD 3.264.000	Fund receives Fixed 4,053%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	16/8/2025	(46.864)	(46.864)
IRS	USD 1.569.000	Fund receives Fixed 4,1115%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	24/8/2025	(20.738)	(20.738)
IRS	USD 1.632.000	Fund receives Fixed 4,1527%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	24/8/2025	(20.313)	(20.313)
IRS	USD 1.569.000	Fund receives Fixed 4,1005%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	25/8/2025	(21.052)	(21.052)
IRS	USD 1.632.000	Fund receives Fixed 4,1327%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	25/8/2025	(20.914)	(20.914)
IRS	USD 3.138.000	Fund receives Fixed 4,181%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/8/2025	(37.282)	(37.282)
IRS	CAD 1.367.000	Fund receives Fixed 4,3815%; and pays Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day	Bank of America	20/7/2026	(4.594)	(4.594)
IRS	CAD 1.367.000	Fund receives Fixed 4,396%; and pays Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day	Bank of America	20/7/2026	(4.187)	(4.187)
IRS	JPY 31.685.835	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,885%	Bank of America	15/2/2033	(2.096)	(2.096)
IRS	JPY 31.685.835	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,8975%	Bank of America	15/2/2033	(2.346)	(2.346)
IRS	JPY 63.371.670	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,9%	Bank of America	15/2/2033	(4.791)	(4.791)
IRS	JPY 91.779.660	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,9175%	Bank of America	15/2/2033	(7.949)	(7.949)
IRS	CAD 991.962	Fund receives Fixed 3,54%; and pays Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day	Bank of America	15/6/2033	(14.832)	(14.832)
IRS	CAD 447.920	Fund receives Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day; and pays Fixed 3,5675%	Bank of America	20/7/2033	5.536	5.536

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Inflation Linked Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	CAD 447.000	Fund receives Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day; and pays Fixed 3,569%	Bank of America	20/7/2033	5.483	5.483
IRS	CAD 441.000	Fund receives Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day; and pays Fixed 3,404%	Bank of America	15/6/2053	7.688	7.688
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 48.340.675)					(215.924)	(215.478)

IFS: Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)
IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
130	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 94,875	13/10/2023	77.108	106.438
195	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95	13/10/2023	163.048	216.938
325	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,625	13/10/2023	515.739	857.187
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 138.154.458)						755.895	1.180.563

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(130)	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 95,125	13/10/2023	(125.204)	(183.625)
(195)	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,25	13/10/2023	(234.932)	(333.937)
(325)	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,375	13/10/2023	(436.917)	(656.094)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 142.036.355)						(797.053)	(1.173.656)

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
USD 58.384.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,5% Fixed semi-annually from 24/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 24/1/2025	Citibank	22/1/2024	(73.143)	71.941
USD 58.384.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,55% Fixed semi-annually from 26/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/1/2025	Citibank	24/1/2024	(59.703)	80.710
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 35.865.661)				(132.846)	152.651

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (3.138.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,3% Fixed semi-annually from 5/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 5/9/2024	JP Morgan	31/8/2023	(22.059)	(30.453)
USD (3.138.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,39% Fixed semi-annually from 7/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 7/9/2024	JP Morgan	5/9/2023	(16.227)	(24.794)
USD (3.139.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,605% Fixed semi-annually from 7/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 7/9/2024	Barclays	5/9/2023	(3.389)	(12.414)
USD (58.384.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 24/1/2025; and pays 3,8% Fixed semi-annually from 24/7/2024	Citibank	22/1/2024	37.370	(23.933)
USD (58.384.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 26/1/2025; and pays 3,85% Fixed semi-annually from 26/7/2024	Citibank	24/1/2024	27.703	(27.178)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 20.273.597)				23.398	(118.772)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Inflation Linked Bond Fund suite

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 9.417.360	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	9.133.537	3,38
USD 12.153.606	Fannie Mae or Freddie Mac 5,5% TBA	12.006.517	4,44
<hr/>			
Total TBA (USD Exposition sous-jacente - USD 21.140.054)		21.140.054	7,82

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Long-Horizon Equity Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	111.242	USD	82.633	BNY Mellon	15/9/2023	(294)
USD	24.377	SGD	32.771	BNY Mellon	15/9/2023	119
Moins-value nette non réalisée						(175)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 106.542)						(175)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	29,67
Finance	22,79
Technologie	19,46
Valeurs industrielles	8,25
Énergie	5,68
Biens de consommation cyclique	5,15
Communications	4,13
Matériaux de base	3,00
Autres éléments de l'actif net	1,87
	100,00

Global Multi-Asset Income Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				151.000	China Medical System	217.943	0,01
COMPARTIMENTS				650.000	China Mengniu Dairy	2.187.945	0,05
Irlande				713.000	CK Asset	3.936.375	0,08
55.002.185	iShares US Mortgage Backed Securities UCITS ETF*~	223.006.359	4,61	184.000	ENN Energy	1.442.819	0,03
1.110.576	iShares USD Corp Bond UCITS ETF*~	111.901.638	2,31	76.000	Gourmet Master	269.668	0,00
		334.907.997	6,92	18.500	Hengan International	68.641	0,00
Luxembourg				35.500	Kingboard	80.569	0,00
4.138.307	BlackRock Global Funds - US Dollar High Yield Bond Fund™	39.769.131	0,82	10.000	NetEase	208.849	0,00
Total des Compartiments		374.677.128	7,74	747.600	Sands China	2.530.771	0,05
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES				2.370	Sohu.com	25.715	0,00
Australie				5.830.000	SUNeVision	2.787.526	0,06
802.355	Atlas Arteria*	3.159.939	0,07	36.800	Tencent	1.524.931	0,03
260.074	Goodman	3.935.304	0,08	358.000	Tingyi Cayman Islands	525.841	0,01
453.835	NEXTDC*	3.980.386	0,08	172.000	Uni-President China	127.197	0,00
1.154.764	Transurban	9.918.484	0,20	49.000	Want Want China	32.425	0,00
		20.994.113	0,43	2.168.800	Wynn Macau	2.115.437	0,05
Belgique						28.482.815	0,58
25.775	Azelis	566.001	0,01	Chili			
15.220	VGP	1.599.271	0,03	241.189	Cencosud	511.848	0,01
129.620	Warehouses De Pauw CVA	3.723.898	0,08	7.952	Cia Cervecerias Unidas	117.292	0,01
		5.889.170	0,12	12.345	Cia Cervecerias Unidas	91.496	0,00
Bermudes				1.014.036	Enel Americas	121.420	0,00
299.000	CK Infrastructure	1.513.494	0,03	28.988	Sociedad Quimica y Minera de Chile*	1.803.633	0,04
232.000	Kunlun Energy	169.793	0,00			2.645.689	0,06
		1.683.287	0,03	Chine			
Brésil				6.907.000	Bank of China	2.342.557	0,05
895.155	Ambev	2.554.558	0,06	142.000	Bank of Communications	81.293	0,00
1.116.971	B3 - Brasil Bolsa Balcao	2.951.787	0,06	33.601	Bloomage Biotechnology	427.486	0,01
625.480	Banco Bradesco	1.897.959	0,04	632.800	BOE Technology	348.784	0,01
58.173	CPFL Energia	406.292	0,01	35.100	BYD	1.203.232	0,02
564.176	Cyrela Brazil Realty Empreendimentos e Participacoes	2.613.139	0,05	291.800	By-health	775.288	0,02
2.837.375	Hapvida Participacoes e Investimentos	2.533.970	0,05	832.000	China Construction Bank	445.545	0,01
910.690	Sendas Distribuidora	2.199.630	0,05	5.770.000	China Petroleum & Chemical	3.376.817	0,07
44.945	Telefonica Brasil*	387.426	0,01	393.761	China Railway Signal & Communication	303.628	0,01
80.068	Telefonica Brasil	685.647	0,01	473.000	China Suntien Green Energy	166.452	0,00
		16.230.408	0,34	3.374.000	China Tower	326.947	0,01
Canada				145.500	China Yangtze Power	441.179	0,01
90.337	Barrick Gold	1.478.817	0,03	1.162.400	GF	1.659.941	0,03
34.637	Boralex	846.942	0,02	18.300	Guangdong Haid	121.340	0,00
43.979	Canadian Pacific Kansas City	3.506.987	0,07	848.000	Guangzhou Automobile	446.545	0,01
105.889	Enbridge	3.747.597	0,08	442.638	Heilongjiang Agriculture	816.483	0,02
16.062	Fortis*	635.661	0,01	6.700	Henan Shuanghui Investment & Development	24.736	0,00
115.680	Pembina Pipeline*	3.626.389	0,08	6.908.000	Industrial & Commercial Bank of China	3.170.837	0,07
52.506	Rogers Communications	2.162.947	0,05	459.500	Joinn Laboratories China	1.515.803	0,03
41.728	TC Energy	1.522.477	0,03	11.700	Kweichow Moutai	2.970.289	0,06
527.861	TELUS	9.352.668	0,19	91.700	Maxscend Microelectronics	1.564.182	0,03
		26.880.485	0,56	1.599.000	People's Insurance of China	544.351	0,01
Îles Caïmans				433.100	Shanghai Construction	166.684	0,00
516.000	3SBio	431.591	0,01	35.000	Shanghai Junshi Biosciences	95.500	0,00
48.000	91APP	158.259	0,00	156.800	Shanghai Pharmaceuticals	257.902	0,01
435.000	Alibaba	5.002.820	0,10	27.600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	1.024.280	0,02
45.337	Alibaba	4.205.460	0,09	50.000	Tsingtao Brewery*	416.615	0,01
1.339	Autohome	38.737	0,00	54.700	Tsingtao Brewery	684.939	0,02
936.000	China Feihe	563.296	0,01	89.500	Wuliangye Yibin	1.917.975	0,04
				87.000	Yangtze Optical Fibre & Cable Joint Stock*	121.576	0,00
				184.000	Zhejiang Expressway	137.478	0,00
				119.000	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical	921.367	0,02
				1.502.000	Zijin Mining	2.363.220	0,05
				63.200	ZTE	307.949	0,01
						31.489.200	0,66

∞ Participation croisée d'un fonds à compartiments multiples et investissement dans le fonds d'une partie liée, pour de plus amples informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

~ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Colombie				Hongrie			
116.540	Ecopetrol	1.393.818	0,03	220.907	MOL Hungarian Oil & Gas	1.687.732	0,04
République tchèque				61.547	OTP Bank	2.526.684	0,05
21.472	Moneta Money Bank	81.441	0,00	4.214.416 0,09			
Danemark				Inde			
7.932	Carlsberg	1.166.400	0,02	27.320	Asian Paints	1.074.534	0,03
64.117	Novo Nordisk	11.928.322	0,25	271.971	Axis Bank	3.198.161	0,07
1.988	Novo Nordisk*	369.927	0,01	16.095	Birlasoft	99.094	0,00
107.712	Tryg	2.059.859	0,04	37.649	Cipla	571.923	0,01
15.524.508 0,32				17.148	Colgate-Palmolive India	402.268	0,01
Égypte				9.029	Cummins India	186.254	0,00
125.208	Commercial International Bank Egypt	173.985	0,01	16.136	Dr Reddy's Laboratories	1.093.035	0,02
90.121	Commercial International Bank Egypt	110.668	0,00	158.462	Godrej Consumer Products	1.923.968	0,04
284.653 0,01				269.781	HDFC Bank	5.120.987	0,11
Finlande				864	ICICI Bank	20.123	0,00
326.584	Nokia	1.306.336	0,03	98.373	ICICI Bank	1.139.260	0,02
49.687	Sampo	2.199.433	0,04	19.948	Indus Towers	42.216	0,00
38.416	UPM-Kymmene	1.324.567	0,03	190.190	Infosys*	3.318.816	0,07
4.830.336 0,10				73.370	InterGlobe Aviation	2.158.039	0,04
France				48.104	Kotak Mahindra Bank	1.021.944	0,02
33.307	Aéroports de Paris*	4.451.989	0,09	56.481	Lupin	749.009	0,02
53.203	Air Liquide*	9.716.979	0,20	22.995	Maruti Suzuki India	2.778.690	0,06
23.745	ALD	231.343	0,00	101.405	Petronet LNG	263.721	0,01
19.546	BNP Paribas	1.273.441	0,03	168.431	SBI Cards & Payment Services	1.661.294	0,03
27.544	Cie de Saint-Gobain	1.793.920	0,04	1.384	Shree Cement	397.902	0,01
16.915	Danone	996.506	0,02	17.822	Syngene International	166.635	0,00
8.392	Eiffage	839.104	0,02	97.271	Tata Consultancy Services	3.944.124	0,08
81.048	Engie*	1.315.296	0,03	3.301	Torrent Pharmaceuticals	73.468	0,00
49.702	EssilorLuxottica	9.484.144	0,20	65.973	United Spirits	802.924	0,02
61.269	Getlink	1.029.342	0,02	60.980	Zydus Lifesciences	460.998	0,01
10.747	Kering*	5.811.880	0,12	32.669.387 0,68			
1.680	L'Oreal	748.039	0,01	Indonésie			
6.650	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	5.728.619	0,12	2.743.300	Ace Hardware Indonesia	131.491	0,00
169.887	Sanofi	18.341.493	0,38	5.656.300	Astra International	2.395.478	0,05
7.160	Schneider Electric	1.238.874	0,02	39.100	Bank Central Asia	23.555	0,00
21.135	Vinci	2.376.498	0,05	23.176.003	Bank Rakyat Indonesia Persero	8.445.621	0,18
65.377.467 1,35				3.458.200	Telkom Indonesia Persero	846.953	0,02
Allemagne				11.929	Telkom Indonesia Persero	292.857	0,00
58.293	Bayer	3.220.421	0,07	12.135.955 0,25			
47.092	Fraport Frankfurt Airport Services Worldwide*	2.539.284	0,05	Irlande			
3.560	Merck*	644.635	0,01	40.950	Accenture	13.321.854	0,28
4.730	MTU Aero Engines	1.113.599	0,02	3.596	Allegion	410.448	0,01
26.054	RWE	1.082.633	0,02	21.038	CRH	1.215.207	0,02
9.149	SAP	1.290.203	0,03	3.460	Linde	1.345.283	0,03
15.500	Siemens	2.343.232	0,05	170.580	Medtronic	14.064.321	0,29
170.767	Vonovia	4.118.615	0,09	10.944	Willis Towers Watson	2.285.435	0,05
16.352.622 0,34				32.642.548 0,68			
Grèce				Italie			
2.653	Hellenic Telecommunications Organization	40.067	0,00	290.666	Terna - Rete Elettrica Nazionale	2.411.217	0,05
6.084	JUMBO	189.311	0,00	60.940	UniCredit	1.504.483	0,03
111.929	OPAP	1.899.272	0,04	3.915.700 0,08			
2.128.650 0,04				Japon			
Hong Kong				373.200	Hulic	3.339.918	0,07
167.000	BYD Electronic International	773.998	0,01	17.400	Japan Airport Terminal*	822.290	0,02
24.000	China Resources Beer	141.069	0,00	223.200	Komatsu*	6.337.657	0,13
182.500	CLP	1.431.057	0,03	28.560	Sony*	2.375.621	0,05
596.000	CSPC Pharmaceutical	448.350	0,01	72.200	Tokyo Gas	1.668.225	0,03
1.334.235	Hang Lung Properties*	1.782.841	0,04	21.500	West Japan Railway*	927.344	0,02
1.085.520	Link REIT	5.384.018	0,11	15.471.055 0,32			
9.961.333 0,20				Jersey			
Indonésie				33.837	Experian	1.193.725	0,02
Indonésie				41.698	Ferguson*	6.831.957	0,14
Indonésie				8.025.682 0,16			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Kazakhstan				201.178	Mesaieed Petrochemical	101.556	0,01
28.970	Kaspi.KZ JSC	3.012.880	0,06	73.670	Ooredoo QPSC	218.284	0,01
Koweït				24.892	Qatar Electricity & Water QSC	122.311	0,00
129.408	Boubyan Bank KSCP	256.024	0,01	160.025	Qatar Gas Transport	162.749	0,00
212.190	Gulf Bank KSCP	173.426	0,00	56.021	Qatar International Islamic Bank QSC	152.020	0,00
469.956	Kuwait Finance House KSCP	1.135.541	0,02	37.742	Qatar Islamic Bank SAQ	200.051	0,01
9.566	Mabaneer KPSC	25.937	0,00	153.635	Qatar National Bank QPSC	657.541	0,01
198.079	Mobile Telecommunications KSCP	327.641	0,01			2.205.065	0,05
201.977	National Bank of Kuwait SAKP	602.669	0,01	Arabie Saoudite			
		2.521.238	0,05	56.360	Abdullah Al Othaim Markets	218.790	0,00
Luxembourg				15.449	Almarai JSC	261.147	0,00
31.620	ADLER	17.530	0,00	4.462	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services	289.088	0,01
139.816	SES	1.022.409	0,02	23.473	Etiihad Etisalat	282.566	0,01
		1.039.939	0,02	81.850	Jarir Marketing	322.107	0,01
Malaisie				10.041	Nahdi Medical	406.390	0,01
675.900	CIMB	820.111	0,02	8.467	Sahara International Petrochemical	82.285	0,00
290.500	Gamuda	281.735	0,01	2.006	Saudi Airlines Catering	57.656	0,00
61.500	Hong Leong Bank	264.556	0,00	123.214	Saudi Arabian Oil	1.146.516	0,02
226.400	IHH Healthcare	290.319	0,01	21.532	Saudi Aramco Base Oil	840.465	0,02
126.300	IOI	109.696	0,00	131.554	Saudi Basic Industries	3.100.637	0,07
391.800	Malayan Banking	769.245	0,02	108.531	Saudi Telecom	1.151.679	0,02
112.200	Malaysia Airports	178.214	0,00	44.366	Seera	343.038	0,01
98.500	Maxis	85.126	0,00			8.502.364	0,18
103.100	MISC	159.982	0,00	Singapour			
3.200	Nestle Malaysia	90.000	0,00	299.000	BOC Aviation	2.243.555	0,05
15.400	Petronas Dagangan	73.681	0,00	1.286.600	Cromwell European Real Estate Investment Trust	1.982.165	0,04
27.300	Petronas Gas	100.728	0,00	250.112	DBS	6.161.607	0,13
29.700	PPB	100.621	0,00			10.387.327	0,22
839.500	Public Bank	765.319	0,02	Afrique du Sud			
59.600	QL Resources	69.362	0,00	200.169	Absa	1.959.983	0,04
259.300	Sime Darby	128.532	0,00	78.351	Gold Fields	1.014.142	0,02
47.700	Telekom Malaysia	52.429	0,00	26.820	Gold Fields*	345.710	0,01
149.000	TIME dotCom	176.616	0,01	681.226	Truworths International	2.577.347	0,05
		4.516.272	0,09			5.897.182	0,12
Mexique				Corée du Sud			
1.494.200	Fibra Uno Administracion	2.293.687	0,05	2.856	CJ Logistics	170.485	0,00
131.781	Grupo Aeroportuario del Pacifico	2.547.350	0,05	1.107.616	ESR Kendall Square REIT	3.289.119	0,07
467.282	Grupo Financiero Banorte	4.133.795	0,08	10.797	Hansol Chemical	1.319.248	0,03
45.959	Inmobiliaria Vesta	1.753.336	0,04	2.799	Hugel	238.023	0,01
2.287.230	Wal-Mart de Mexico	9.338.620	0,20	4.877	Hyundai Glovis	636.491	0,01
		20.066.788	0,42	16.014	Kia	971.684	0,02
Pays-Bas				48.379	LG Uplus	382.494	0,01
20.720	Airbus*	3.058.638	0,06	426	NongShim	147.775	0,00
2.989	ASML	1.990.817	0,04	20.475	Samsung Electronics	1.036.336	0,02
28.304	ASR Nederland	1.251.363	0,03	4.396	Samsung Electronics	5.560.940	0,12
2.522.585	Koninklijke KPN	8.842.816	0,18	194.828	Samsung Electronics	7.959.683	0,16
97.850	Koninklijke Philips	2.213.475	0,04	2.543	Samsung SDI	1.181.314	0,03
24.772	Koninklijke Vopak	892.023	0,02	5.583	Samsung SDS	599.800	0,01
41.722	Prosus	2.916.494	0,06	29.042	SK Telecom	1.055.773	0,02
29.582	STMicroelectronics	1.410.087	0,03	6.166	SK Telecom	124.183	0,00
		22.575.713	0,46	36.537	S-Oil	2.017.931	0,04
Nouvelle-Zélande						26.691.279	0,55
463.011	Auckland International Airport	2.150.685	0,04	Espagne			
Pologne				39.124	Aena SME	6.180.341	0,13
282.541	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski	2.568.131	0,05	192.924	Cellnex Telecom*	7.438.947	0,15
45.269	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	455.649	0,01	19.617	Industria de Diseno Textil	756.624	0,02
		3.023.780	0,06			14.375.912	0,30
Qatar				Suède			
32.684	Dukhan Bank	37.482	0,00	21.688	Alfa Laval	767.383	0,02
163.100	Industries Qatar QSC	553.071	0,01	51.310	Epiroc	990.526	0,02
				163.438	Tele2	1.161.674	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
56.500	Volvo	1.149.759	0,02	94.241	Emirates Telecommunications	509.042	0,01
		4.069.342	0,08	239.957	First Abu Dhabi Bank	893.700	0,02
				1.148.102	Salik	1.047.123	0,02
	Suisse					5.978.273	0,12
20.019	Flughafen Zurich*	4.156.982	0,09		Royaume-Uni		
17.524	Lonza	9.753.974	0,20	11.049.194	Assura*	6.434.591	0,13
135.149	Nestle	16.333.397	0,34	131.227	AstraZeneca	17.889.269	0,37
5.992	Roche	1.778.517	0,04	966.192	BAE Systems	12.392.495	0,26
4.240	Sika*	1.204.970	0,02	867.964	BP	5.396.297	0,11
52.779	TE Connectivity	7.014.857	0,14	141.145	British American Tobacco	4.736.077	0,10
20.932	Zurich Insurance	9.873.394	0,20	209.489	Haleon	863.730	0,02
		50.116.091	1,03	76.544	Hochschild Mining*	89.414	0,00
	Taiwan			1.212.454	LondonMetric Property	2.783.448	0,06
187.000	Accton Technology	2.806.774	0,06	2.621.327	LXI REIT*	3.111.919	0,06
70.000	Asustek Computer	884.712	0,02	482.698	National Grid	6.104.236	0,12
246.000	Cathay Financial	352.239	0,01	142.306	Phoenix	935.164	0,02
400.968	Chang Hwa Commercial Bank	217.818	0,00	962.969	Prudential	12.012.642	0,25
306.000	Chunghwa Telecom	1.114.595	0,02	15.163	Reckitt Benckiser	1.104.460	0,02
526	Chunghwa Telecom	19.257	0,00	329.644	RELX*	10.802.749	0,22
976.000	Compal Electronics	977.639	0,02	550.577	Shell*	17.011.565	0,35
164.000	Delta Electronics	1.781.795	0,04	62.344	SSE	1.288.985	0,03
780.483	E.Sun Financial	599.212	0,01	3.641.296	Target Healthcare REIT	3.340.445	0,07
100.000	Elan Microelectronics	376.807	0,01	6.201.609	Taylor Wimpey	9.048.552	0,19
256.000	Far EasTone			41.885	Unilever*	2.162.103	0,05
	Telecommunications	567.522	0,01	124.962	United Utilities	1.496.006	0,03
77.000	FLEXium Interconnect	219.782	0,01	3.274.478	Vodafone	3.056.717	0,06
335.000	Hon Hai Precision Industry	1.120.295	0,02			122.060.864	2,52
520.000	Hua Nan Financial	334.730	0,01		États-Unis		
17.000	Largan Precision	1.094.311	0,02	73.771	AbbVie	10.963.108	0,23
71.000	Lotes	1.928.468	0,04	67.143	Alexandria Real Estate Equities	7.879.231	0,16
355.000	MediaTek	7.858.785	0,16	80.072	Alliant Energy*	4.068.458	0,08
6.144	Mega Financial	6.926	0,00	349.250	Allstate	7.033.895	0,15
26.000	Novatek Microelectronics	326.158	0,01	5.754	Alphabet	793.074	0,02
187.000	PharmaEngine	510.269	0,01	30.936	Ameren	2.491.277	0,05
28.350	Poya International	432.641	0,01	64.605	American Electric Power	5.140.619	0,10
60.000	President Chain Store	503.980	0,01	43.299	American Express	6.937.799	0,14
233.000	Primax Electronics	485.073	0,01	69.856	American International	4.081.686	0,09
94.000	Radiant Opto-Electronics	352.723	0,01	63.821	American Tower	11.649.248	0,24
222.000	Sincere Navigation	139.070	0,00	84.900	Apple	15.966.294	0,33
526.450	Taiwan Cooperative Financial	433.935	0,01	47.755	Assurant	6.639.378	0,14
61.000	Taiwan High Speed Rail	56.984	0,00	123.677	AT&T	1.831.656	0,03
183.000	Taiwan Mobile	535.556	0,01	262.773	Baker Hughes	9.492.675	0,20
1.451.000	Taiwan Semiconductor			130.900	Baxter International	5.419.260	0,11
	Manufacturing	25.013.685	0,52	62.793	Boston Properties*	4.224.713	0,09
10.677	Taiwan Semiconductor			40.181	Cardinal Health	3.550.393	0,07
	Manufacturing	1.002.250	0,02	113.368	Carlyle	3.675.391	0,08
383.000	Uni-President Enterprises	850.269	0,02	155.137	Carrier Global*	8.952.956	0,18
301.000	Yuanta Financial	230.619	0,01	19.119	CenterPoint Energy	536.862	0,01
		53.134.879	1,11	21.209	Cheniere Energy	3.490.577	0,08
	Thaïlande			13.956	Cigna	3.925.124	0,08
1.469.000	Bangkok Dusit Medical Services	1.174.612	0,02	65.454	Cisco Systems	3.749.532	0,08
122.000	Bumrungrad Hospital	902.349	0,02	139.582	Citigroup	5.796.841	0,12
1.308.000	CP ALL	2.437.266	0,05	291.480	Citizens Financial	8.208.077	0,17
2.503.600	Home Product Center	979.491	0,02	59.229	CMS Energy	3.367.761	0,07
256.400	PTT Exploration & Production	1.160.545	0,03	65.649	Cognizant Technology Solutions	4.706.377	0,10
18.200	Siam Cement	162.678	0,00	84.984	Comcast	4.016.344	0,09
		6.816.941	0,14	25.169	Community Healthcare Trust	844.168	0,02
	Turquie			14.058	ConocoPhillips	1.670.512	0,03
76.975	Turkcell Iletisim Hizmetleri	164.433	0,00	42.257	Crown Castle	4.275.986	0,09
	Émirats arabes unis			92.046	CSX	2.800.039	0,06
784.338	Abu Dhabi Commercial Bank	1.842.835	0,04	23.266	Digital Realty Trust	3.062.503	0,06
93.995	Abu Dhabi Islamic Bank	266.652	0,00	23.725	Dollar General	3.111.297	0,07
484.948	Abu Dhabi National Oil for			12.096	Dominion Energy	595.970	0,01
	Distribution	503.029	0,01	33.306	DT Midstream*	1.748.232	0,04
290.948	Dubai Islamic Bank	446.752	0,01	35.331	DTE Energy	3.710.462	0,08
105.393	Emirates NBD Bank	469.140	0,01	78.738	Duke Energy	7.093.506	0,15
				312.045	Dun & Bradstreet	3.404.411	0,07
				20.644	Edison International*	1.448.383	0,03

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 4.000.000	Symphony CLO 38 6,622% 24/4/2036	4.053.560	0,08	USD 640.000	Enbridge 5,7% 8/3/2033	640.547	0,01
USD 2.221.000	Valaris 8,375% 30/4/2030	2.266.308	0,05	USD 3.125.000	Enbridge 6% 15/1/2077	2.950.735	0,06
USD 639.000	Viking Cruises 5,875% 15/9/2027	598.082	0,01	USD 986.000	Enerflex 9% 15/10/2027	981.079	0,02
USD 147.000	Viking Cruises 7% 15/2/2029	139.415	0,00	USD 834.000	ERO Copper 6,5% 15/2/2030	729.012	0,02
USD 1.938.000	Viking Cruises 9,125% 15/7/2031	1.997.532	0,04	USD 1.073.000	First Quantum Minerals 8,625% 1/6/2031	1.093.153	0,02
USD 515.000	Viking Ocean Cruises Ship VII 5,625% 15/2/2029	481.010	0,01	USD 562.000	Garda World Security 4,625% 15/2/2027	520.412	0,01
USD 667.000	Weatherford International 6,5% 15/9/2028	668.709	0,01	USD 1.468.000	Garda World Security 7,75% 15/2/2028	1.465.812	0,03
USD 1.708.000	Weatherford International 8,625% 30/4/2030	1.752.051	0,04	USD 220.000	Garda World Security 9,5% 1/11/2027	212.878	0,00
		26.587.096	0,55	USD 730.000	GFL Environmental 3,5% 1/9/2028	646.286	0,01
				USD 651.000	GFL Environmental 3,75% 1/8/2025	620.919	0,01
				USD 568.000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	509.729	0,01
				USD 283.000	GFL Environmental 4,25% 1/6/2025	274.056	0,01
				USD 1.583.000	GFL Environmental 4,375% 15/8/2029	1.408.440	0,03
				USD 1.286.000	GFL Environmental 4,75% 15/6/2029	1.179.342	0,02
				USD 309.000	GFL Environmental 5,125% 15/12/2026	299.325	0,01
				USD 1.504.000	Husky III 13% 15/2/2025	1.500.240	0,03
				USD 1.306.000	Jones Deslauriers Insurance Management 8,5% 15/3/2030	1.334.392	0,03
				USD 946.000	Jones Deslauriers Insurance Management 10,5% 15/12/2030	963.971	0,02
				USD 695.000	Masonite International 3,5% 15/2/2030	582.681	0,01
				USD 271.000	Masonite International 5,375% 1/2/2028	255.925	0,00
				USD 79.000	Mattamy 4,625% 1/3/2030	69.755	0,00
				USD 599.000	Mattamy 5,25% 15/12/2027	563.891	0,01
				USD 2.175.000	New Gold 7,5% 15/7/2027	2.077.064	0,04
				USD 215.000	Nutrien 4,9% 27/3/2028	210.019	0,01
				USD 60.000	Nutrien 5,8% 27/3/2053	58.639	0,00
				USD 100.000	Nutrien 5,9% 7/11/2024	99.967	0,00
				USD 467.000	Ontario Gaming GTA 8% 1/8/2030	472.711	0,01
				USD 3.189.000	Open Text 6,9% 1/12/2027	3.237.329	0,07
				USD 236.000	Precision Drilling 6,875% 15/1/2029	224.575	0,01
				USD 121.000	Rogers Communications 3,7% 15/11/2049	82.351	0,00
				USD 960.000	Rogers Communications 3,8% 15/3/2032	819.056	0,02
				USD 281.000	Rogers Communications 4,3% 15/2/2048	210.946	0,01
				USD 83.000	Rogers Communications 4,35% 1/5/2049	62.902	0,00
				USD 757.000	Rogers Communications 4,55% 15/3/2052	586.350	0,01
				USD 296.000	Teck Resources 5,2% 1/3/2042	254.575	0,01
				USD 19.000	Teck Resources 5,4% 1/2/2043	16.632	0,00
				USD 72.000	Teck Resources 6% 15/8/2040	68.323	0,00
				USD 41.000	Teck Resources 6,25% 15/7/2041	39.967	0,00
				USD 212.000	Tervita 11% 1/12/2025	221.739	0,01
				USD 2.606.000	Titan Acquisition / Titan Co-Borrower 7,75% 15/4/2026*	2.532.102	0,05
				USD 560.000	Toronto-Dominion Bank/The 0,7% 10/9/2024	532.670	0,01
				USD 191.000	Toronto-Dominion Bank/The 1,25% 10/9/2026	169.248	0,00
Brésil							
USD 1.030.000	Banco do Brasil 4,75% 20/3/2024*	1.021.338	0,02				
USD 849.000	Banco do Brasil 6,25% 18/4/2030	843.184	0,02				
USD 591.000	Banco Votorantim 4,5% 24/9/2024	578.955	0,01				
USD 608.000	Centrais Eletricas Brasileiras 3,625% 4/2/2025	579.880	0,01				
USD 542.000	Itau Unibanco 3,25% 24/1/2025	521.008	0,01				
		3.544.365	0,07				
Îles Vierges britanniques							
EUR 296.000	Global Switch 2,25% 31/5/2027	298.943	0,01				
Canada							
USD 170.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,875% 15/1/2028	154.846	0,01				
USD 1.244.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	1.059.539	0,02				
USD 1.109.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4,375% 15/1/2028	1.019.107	0,02				
USD 419.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 5,75% 15/4/2025	416.412	0,01				
USD 2.150.000	Air Canada 3,875% 15/8/2026	1.988.640	0,04				
USD 290.000	ATS 4,125% 15/12/2028	258.066	0,01				
USD 447.000	Baytex Energy 8,5% 30/4/2030	453.564	0,01				
USD 2.329.000	Bombardier 6% 15/2/2028	2.177.137	0,05				
USD 3.480.000	Bombardier 7,125% 15/6/2026	3.424.519	0,07				
USD 400.000	Bombardier 7,45% 1/5/2034	455.600	0,01				
USD 1.615.000	Bombardier 7,5% 1/2/2029	1.587.017	0,03				
USD 1.163.000	Bombardier 7,875% 15/4/2027	1.161.354	0,02				
USD 1.904.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 4,875% 15/2/2030	1.570.242	0,03				
USD 602.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	502.221	0,01				
USD 290.000	Canadian National Railway 3,85% 5/8/2032	267.907	0,01				
USD 205.000	Canadian Pacific Railway 3,1% 2/12/2051	139.571	0,00				
USD 100.000	Canadian Pacific Railway 4,8% 1/8/2045	89.546	0,00				
USD 190.000	Cenovus Energy 3,75% 15/2/2052	133.644	0,00				
USD 175.000	Enbridge 0,55% 4/10/2023	174.247	0,00				
USD 520.000	Enbridge 2,5% 15/1/2025	498.050	0,01				
USD 135.000	Enbridge 2,5% 1/8/2033	104.912	0,00				
USD 200.000	Enbridge 4% 1/10/2023	199.661	0,01				
USD 42.000	Enbridge 4% 15/11/2049	31.584	0,00				
USD 480.000	Enbridge 4,25% 1/12/2026	462.734	0,01				
USD 49.000	Enbridge 4,5% 10/6/2044	40.230	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 635.000	Toronto-Dominion Bank/The 5,532% 17/7/2026	635.963	0,01	USD 1.000.000	Anchorage Capital CLO 3-R 7,127% 28/1/2031	992.905	0,02
USD 413.000	TransAlta 7,75% 15/11/2029	425.483	0,01	USD 1.000.000	Anchorage Capital CLO 3-R 7,477% 28/1/2031	981.224	0,02
USD 663.000	Vermilion Energy 6,875% 1/5/2030	631.962	0,01	USD 1.500.000	Anchorage Capital CLO 3-R 8,227% 28/1/2031	1.413.010	0,03
		50.843.503	1,04	USD 700.000	Anchorage Capital CLO 4-R 7,477% 28/1/2031	684.169	0,01
	Îles Caïmans			USD 1.000.000	Annisa CLO 2016-2 8,588% 20/7/2031	981.343	0,02
USD 1.000.000	AGL CLO 11 7,62% 15/4/2034	996.847	0,02	USD 997.068	Apidos CLO XII 6,65% 15/4/2031	991.719	0,02
USD 1.000.000	AGL CLO 11 8,72% 15/4/2034	986.561	0,02	USD 1.000.000	Apidos CLO XV 7,438% 20/4/2031	982.427	0,02
USD 2.681.223	AGL CLO 12 7,188% 20/7/2034	2.651.745	0,06	USD 500.000	Apidos CLO XX 7,52% 16/7/2031	494.841	0,01
USD 1.000.000	AGL CLO 12 7,438% 20/7/2034	983.919	0,02	USD 1.500.000	Apidos CLO XXIX 7,163% 25/7/2030	1.486.583	0,03
USD 3.000.000	AGL CLO 13 7,238% 20/10/2034	2.961.687	0,06	USD 5.000.000	Apidos CLO Xxv 6,758% 20/10/2031	4.972.468	0,10
USD 5.500.000	AGL CLO 14 7,245% 2/12/2034	5.425.218	0,11	USD 711.000	Apidos CLO XXX 7,172% 18/10/2031	704.592	0,01
USD 2.000.000	AGL CLO 17 7,434% 21/1/2035	1.966.679	0,04	USD 1.500.000	Apidos CLO XXXVII 6,737% 22/10/2034	1.490.625	0,03
USD 1.500.000	AGL CLO 17 8,434% 21/1/2035	1.475.432	0,03	USD 500.000	Ares XLIX CLO 7,257% 22/7/2030	494.758	0,01
USD 1.000.000	AGL CLO 17 11,684% 21/1/2035	964.984	0,02	USD 1.900.000	ARES XLV CLO 8,62% 15/10/2030	1.776.596	0,04
USD 7.500.000	AGL CLO 3 6,87% 15/1/2033	7.467.789	0,15	USD 1.500.000	ARES XLVII CLO 8,27% 15/4/2030	1.405.947	0,03
USD 6.500.000	AGL CLO 3 7,27% 15/1/2033	6.441.818	0,13	USD 1.000.000	Ares XLVIII CLO 8,288% 20/7/2030	919.531	0,02
USD 1.000.000	AGL CLO 3 7,72% 15/1/2033	998.380	0,02	USD 500.000	Ares XXXIIR CLO 7,426% 15/5/2030	489.999	0,01
USD 7.000.000	AGL CLO 5 7,288% 20/7/2034	6.918.330	0,14	USD 1.000.000	Ares XXXIR CLO 6,945% 24/5/2030	986.975	0,02
USD 4.500.000	Aimco CLO 11 7,57% 17/10/2034	4.466.048	0,09	USD 1.654.209	Ares XXXVII CLO 6,74% 15/10/2030	1.652.759	0,03
USD 10.000.000	Aimco CLO 12 7,008% 17/1/2032	9.870.000	0,20	USD 1.000.000	Ares XXXVII CLO 7,07% 15/10/2030	990.903	0,02
USD 1.450.000	Aimco CLO 12 8,208% 17/1/2032	1.444.370	0,03	USD 4.500.000	Atlas Senior Loan Fund VII 7,2% 27/11/2031	4.430.796	0,09
USD 2.100.000	Aimco CLO 15 7,22% 17/10/2034	2.073.002	0,04	USD 6.000.000	Atlas Senior Loan Fund XI 6,712% 26/7/2031	5.935.705	0,12
USD 3.750.000	Aimco CLO 15 8,47% 17/10/2034	3.642.442	0,08	USD 1.000.000	Atlas Senior Loan Fund XII 6,787% 24/10/2031	991.244	0,02
USD 6.150.000	AIMCO CLO Series 2017-A 6,638% 20/4/2034	6.092.808	0,13	USD 850.000	Atrium XIV 7,52% 23/8/2030	841.725	0,02
USD 789.741	AIMCO CLO Series 2018-A 6,59% 17/4/2031	787.106	0,02	USD 750.000	Atrium XV 7,357% 23/1/2031	746.451	0,02
USD 500.000	AIMCO CLO Series 2018-A 7,32% 17/4/2031	491.828	0,01	USD 500.000	Atrium XV 7,807% 23/1/2031	499.719	0,01
USD 1.000.000	AIMCO CLO Series 2018-A 8,12% 17/4/2031	982.135	0,02	USD 2.000.000	Bain Capital Credit CLO 2020-5 7,938% 20/1/2032	2.002.805	0,04
USD 520.000	Alibaba 3,15% 9/2/2051*	314.639	0,01	USD 750.000	Ballyrock CLO 16 8,488% 20/7/2034	756.845	0,02
USD 515.000	Alinea CLO 2018-1 7,488% 20/7/2031	506.969	0,01	USD 3.000.000	Ballyrock CLO 2020-2 7,538% 20/10/2031	2.934.671	0,06
USD 1.000.000	Allegany Park CLO 7,376% 20/1/2035	972.553	0,02	USD 592.000	Banco Bradesco 3,2% 27/1/2025	567.983	0,01
USD 1.000.000	Allegany Park CLO 8,426% 20/1/2035	954.465	0,02	USD 7.000.000	Bardot CLO 7,207% 22/10/2032	6.882.401	0,14
USD 1.000.000	Allegany Park CLO 11,726% 20/1/2035	948.622	0,02	USD 4.500.000	Bardot CLO 7,507% 22/10/2032	4.404.676	0,09
USD 800.000	Allegro CLO II-S 7,745% 21/10/2028	798.403	0,02	USD 1.500.000	Bardot CLO 8,607% 22/10/2032	1.469.220	0,03
USD 1.102.023	Allegro CLO VI 6,7% 17/1/2031	1.098.204	0,02	USD 1.500.000	Beechwood Park CLO 11,808% 17/1/2035	1.460.636	0,03
USD 1.000.000	Allegro CLO VI 7,37% 17/1/2031	965.966	0,02	USD 1.647.604	Benefit Street Partners CLO VIII 6,688% 20/1/2031	1.643.282	0,03
USD 1.000.000	Allegro CLO VII 7,22% 13/6/2031	974.506	0,02	USD 1.000.000	Benefit Street Partners CLO XII 7,57% 15/10/2030	987.726	0,02
USD 500.000	Allegro CLO VIII 7,72% 15/7/2031	497.514	0,01	USD 1.300.000	Benefit Street Partners CLO XV 6,722% 18/7/2031	1.292.673	0,03
USD 9.000.000	Allegro CLO XI 6,972% 19/1/2033	8.953.005	0,19	USD 1.500.000	Betony CLO 2 7,231% 30/4/2031	1.484.647	0,03
USD 1.500.000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 11,063% 13/4/2031	1.391.074	0,03	USD 5.000.000	BSL CLO 4 6,957% 20/4/2036	5.038.253	0,10
USD 5.791.836	Anchorage Capital CLO 2013-1 6,813% 13/10/2030	5.775.872	0,12				
USD 1.000.000	Anchorage Capital CLO 2013-1 8,763% 13/10/2030	994.220	0,02				
USD 4.750.000	Anchorage Capital CLO 2018-10 6,77% 15/10/2031	4.735.818	0,10				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.500.000	Canyon Capital CLO 2016-1 7,47% 15/7/2031	1.466.592	0,03	USD 1.000.000	Flatiron CLO 20 9,431% 20/11/2033	987.964	0,02
USD 1.250.000	Canyon Capital CLO 2016-2 7,32% 15/10/2031	1.235.528	0,03	USD 1.000.000	Galaxy XX CLO 7,338% 20/4/2031	983.333	0,02
USD 5.000.000	Canyon Capital CLO 2022-1 7,16% 15/4/2035	4.899.733	0,10	USD 1.200.000	Galaxy XX CLO 8,188% 20/4/2031	1.168.937	0,02
USD 2.000.000	Canyon Capital CLO 2022-1 7,51% 15/4/2035	1.922.258	0,04	USD 1.000.000	Galaxy XXII CLO 7,27% 16/4/2034	980.798	0,02
USD 1.000.000	Canyon Capital CLO 2022-1 8,51% 15/4/2035	972.830	0,02	USD 1.000.000	Galaxy XXII CLO 7,72% 16/4/2034	992.108	0,02
USD 2.500.000	Canyon CLO 2018-1 7,27% 15/7/2031	2.481.744	0,05	USD 1.250.000	Galaxy Xxiv CLO 6,97% 15/1/2031	1.227.608	0,03
USD 3.000.000	Canyon CLO 2021-4 7,57% 15/10/2034	2.920.059	0,06	USD 250.000	Galaxy Xxiv CLO 7,27% 15/1/2031	243.894	0,01
USD 750.000	Carlyle US CLO 2017-2 7,988% 20/7/2031	751.052	0,02	USD 2.435.742	Galaxy XXVII CLO 6,653% 16/5/2031	2.423.155	0,05
USD 750.000	Catskill Park CLO 9,288% 20/4/2029	738.314	0,02	USD 8.287.026	Generate CLO 2 6,757% 22/1/2031	8.239.921	0,17
USD 6.255.000	CBAM 2018-5 6,97% 17/4/2031	6.123.059	0,13	USD 1.000.000	Generate CLO 5 8,957% 22/10/2031	998.268	0,02
USD 600.000	Cedar Funding IX CLO 8,188% 20/4/2031	586.772	0,01	USD 145.000	GGAM Finance 7,75% 15/5/2026	145.748	0,00
USD 1.000.000	CIFC Funding 2013-II 8,622% 18/10/2030	957.284	0,02	USD 145.000	GGAM Finance 8% 15/6/2028	147.102	0,00
USD 5.650.000	CIFC Funding 2013-IV 6,919% 27/4/2031	5.592.492	0,12	USD 960.002	Gilbert Park CLO 6,76% 15/10/2030	958.898	0,02
USD 1.200.000	CIFC Funding 2014-II-R 7,507% 24/4/2030	1.189.343	0,03	USD 1.000.000	Gilbert Park CLO 7,17% 15/10/2030	991.742	0,02
USD 2.000.000	CIFC Funding 2014-V 8,97% 17/10/2031	1.902.492	0,04	USD 1.124.722	Global Aircraft Leasing 6,5% 15/9/2024	1.055.668	0,02
USD 2.500.000	CIFC Funding 2015-I 8,207% 22/1/2031	2.404.699	0,05	USD 4.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 7,388% 20/4/2034	3.919.884	0,08
USD 500.000	CIFC Funding 2017-I 9,095% 23/4/2029	497.343	0,01	USD 1.500.000	Goldentree Loan Management US CLO 10 8,638% 20/7/2034	1.460.956	0,03
USD 1.000.000	CIFC Funding 2017-V 8,42% 16/11/2030	979.922	0,02	USD 3.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 3 6,888% 20/4/2030	2.949.353	0,06
USD 1.000.000	CIFC Funding 2018-I 6,972% 18/4/2031	988.276	0,02	USD 2.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 3 7,488% 20/4/2030	1.960.391	0,04
USD 1.600.000	CIFC Funding 2018-IV 6,72% 17/10/2031	1.593.724	0,03	USD 1.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 4 7,607% 24/4/2031	989.216	0,02
USD 750.000	CIFC Funding 2018-V 6,76% 15/1/2032	748.787	0,02	USD 5.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 7,638% 20/10/2032	4.952.570	0,10
USD 1.000.000	CIFC Funding 2018-V 7,72% 15/1/2032	1.001.434	0,02	USD 800.000	GoldenTree Loan Opportunities IX 7,231% 29/10/2029	797.122	0,02
USD 3.211.846	Clear Creek CLO 6,788% 20/10/2030	3.199.388	0,07	USD 2.000.000	Goldentree Loan Opportunities X 6,708% 20/7/2031	1.996.085	0,04
USD 4.000.000	Clear Creek CLO 7,538% 20/10/2030	3.950.598	0,08	USD 1.000.000	Goldentree Loan Opportunities X 7,688% 20/7/2031	996.432	0,02
USD 6.000.000	Clover CLO 2019-2 6,713% 25/10/2033	5.947.867	0,12	USD 1.974.367	Goldentree Loan Opportunities XI 6,642% 18/1/2031	1.970.193	0,04
USD 1.000.000	Clover CLO 2019-2 7,613% 25/10/2033	984.235	0,02	USD 2.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 7,538% 20/10/2034	1.961.852	0,04
USD 1.500.000	Dryden 50 Senior Loan Fund 7,82% 15/7/2030	1.497.086	0,03	USD 7.500.000	Golub Capital Partners CLO 50B-R 7,276% 20/4/2035	7.416.798	0,15
USD 4.250.000	Dryden 58 CLO 7,37% 17/7/2031	4.152.726	0,09	USD 1.000.000	Golub Capital Partners CLO 50B-R 8,776% 20/4/2035	996.249	0,02
USD 1.000.000	Eaton Vance CLO 2014-1R 8,62% 15/7/2030	966.705	0,02	USD 2.500.000	Golub Capital Partners CLO 53B 7,388% 20/7/2034	2.466.065	0,05
USD 535.000	Eaton Vance CLO 2015-1 7,488% 20/1/2030	521.952	0,01	USD 1.000.000	Golub Capital Partners CLO 53B 7,638% 20/7/2034	976.646	0,02
USD 1.047.000	Fantasia 7,95% 5/7/2022***	50.193	0,00	USD 9.750.000	Golub Capital Partners CLO 55B 7,388% 20/7/2034	9.624.403	0,20
USD 858.000	Fantasia 9,875% 19/10/2023	42.900	0,00	USD 3.000.000	Golub Capital Partners CLO 55B 7,788% 20/7/2034	2.956.381	0,06
USD 1.580.000	Fantasia 11,75% 17/4/2022***	79.000	0,00	USD 4.300.000	Golub Capital Partners CLO 55B 8,788% 20/7/2034	4.315.435	0,09
USD 500.000	Fantasia 11,875% 1/6/2023***	25.000	0,00	USD 925.000	Greenwood Park CLO 8,07% 15/4/2031	864.707	0,02
USD 825.000	Fantasia 12,25% 18/10/2022***	41.250	0,00	USD 6.000.000	Greywolf CLO V 6,773% 27/1/2031	5.981.668	0,12
USD 1.700.000	Fantasia 15% 18/12/2021***	92.641	0,00	USD 1.000.000	GREYWOLF CLO VII 6,766% 20/10/2031	994.386	0,02
USD 3.077.877	Flatiron CLO 17 6,606% 15/5/2030	3.056.664	0,06				
USD 3.105.455	Flatiron CLO 17 7,076% 15/5/2030	3.080.373	0,06				

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 3.400.593	Grippen Park CLO 6,848% 20/1/2030	3.397.421	0,07	USD 3.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 28 8,438% 20/4/2030	2.870.742	0,06
USD 754.000	Grupo Aval 4,375% 4/2/2030	597.168	0,01	USD 6.250.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 7,138% 20/4/2031	6.156.334	0,13
USD 575.000	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5,75% 20/1/2026	532.367	0,01	USD 1.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 31 7,538% 20/4/2031	985.031	0,02
USD 650.000	HPS Loan Management 6-2015 7,381% 5/2/2031	637.645	0,01	USD 2.162.500	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 7,388% 20/7/2031	2.113.446	0,04
USD 1.500.000	HPS Loan Management 8-2016 7,538% 20/7/2030	1.465.536	0,03	USD 2.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 9,188% 20/1/2032	1.983.592	0,04
USD 5.000.000	Invesco CLO 2022-1 7,126% 20/4/2035	4.905.908	0,10	USD 2.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 40 7,32% 16/4/2033	1.967.010	0,04
USD 7.000.000	Invesco CLO 2022-1 7,476% 20/4/2035	6.753.208	0,14	USD 500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 40 8,32% 16/4/2033	485.424	0,01
USD 1.700.000	Invesco CLO 2022-1 8,376% 20/4/2035	1.648.680	0,03	USD 1.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 7,42% 16/7/2035	987.430	0,02
USD 1.500.000	Invesco CLO 2022-1 11,626% 20/4/2035	1.402.294	0,03	USD 4.500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 7,47% 16/10/2034	4.427.715	0,09
USD 1.000.000	KKR CLO 23 7,838% 20/10/2031	992.174	0,02	USD 3.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 8,42% 16/10/2034	2.936.594	0,06
USD 2.356	LCM XX 6,628% 20/10/2027	2.357	0,00	USD 2.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 47 7,111% 14/4/2035	1.972.508	0,04
USD 325.000	LCM XXV 7,238% 20/7/2030	321.624	0,01	USD 2.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 47 7,361% 14/4/2035	1.952.517	0,04
USD 450.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10,875% 15/1/2031	452.722	0,01	USD 4.000.000	Oaktree CLO 2023-1 6,761% 15/4/2036	4.015.913	0,08
USD 1.000.000	Madison Park Funding XIII 7,482% 19/4/2030	994.530	0,02	USD 1.191.906	OCP CLO 2014-6 6,83% 17/10/2030	1.186.092	0,02
USD 2.452.688	Madison Park Funding XXVI 6,831% 29/7/2030	2.446.321	0,05	USD 2.000.000	OCP CLO 2014-6 7,29% 17/10/2030	1.989.192	0,04
USD 500.000	Madison Park Funding XXVII 8,188% 20/4/2030	489.647	0,01	USD 1.400.000	OCP CLO 2014-6 7,72% 17/10/2030	1.381.415	0,03
USD 1.000.000	Madison Park Funding XXVIII 8,27% 15/7/2030	981.603	0,02	USD 891.713	OCP CLO 2016-11 6,882% 26/10/2030	890.791	0,02
USD 500.000	Madison Park Funding XXXI 8,607% 23/1/2031	490.000	0,01	USD 1.000.000	OCP CLO 2018-15 7,288% 20/7/2031	995.005	0,02
USD 880.000	MAF Global 6,375% 20/3/2026	856.517	0,02	USD 1.305.000	OCP CLO 2020-19 8,738% 20/10/2034	1.275.816	0,03
USD 997.000	MAF Sukuk 3,933% 28/2/2030	926.338	0,02	USD 5.500.000	Octagon Investment Partners 26 7,17% 15/7/2030	5.421.874	0,11
USD 990.000	MAF Sukuk 4,638% 14/5/2029*	964.646	0,02	USD 1.250.000	Octagon Investment Partners 26 7,37% 15/7/2030	1.211.322	0,03
USD 3.606.213	Marble Point CLO XI 6,752% 18/12/2030	3.583.010	0,07	USD 2.500.000	Octagon Investment Partners 28 7,857% 24/10/2030	2.473.715	0,05
USD 1.000.000	Marble Point CLO XI 7,072% 18/12/2030	977.265	0,02	USD 2.000.000	Octagon Investment Partners 33 7,438% 20/1/2031	1.962.924	0,04
USD 7.500.000	Marble Point CLO XV 7,357% 23/7/2032	7.368.559	0,15	USD 750.000	Octagon Investment Partners 33 8,338% 20/1/2031	705.049	0,01
USD 6.500.000	Marble Point CLO XVII 6,888% 20/4/2033	6.440.525	0,13	USD 1.000.000	Octagon Investment Partners 34 6,988% 20/1/2030	987.000	0,02
USD 3.500.000	Marble Point CLO XVII 7,358% 20/4/2033	3.441.885	0,07	USD 1.000.000	Octagon Investment Partners 37 7,363% 25/7/2030	977.104	0,02
USD 500.000	Melco Resorts Finance 4,875% 6/6/2025	474.842	0,01	USD 635.000	Octagon Investment Partners 39 7,788% 20/10/2030	630.230	0,01
USD 1.700.000	Melco Resorts Finance 5,375% 4/12/2029*	1.423.767	0,03	USD 4.475.000	Octagon Loan Funding 7,341% 18/11/2031	4.401.718	0,09
USD 400.000	Melco Resorts Finance 5,75% 21/7/2028	354.842	0,01	USD 1.000.000	Octagon Loan Funding 7,841% 18/11/2031	974.578	0,02
USD 260.000	MGM China 4,75% 1/2/2027	235.063	0,01				
USD 200.000	MGM China 5,25% 18/6/2025	192.417	0,00				
USD 200.000	MGM China 5,875% 15/5/2026*	191.477	0,00				
USD 10.000.000	Milos CLO 7,138% 20/10/2030	9.907.412	0,21				
USD 1.000.000	Milos CLO 8,338% 20/10/2030	975.241	0,02				
USD 363.635	Neuberger Berman CLO XVIII 7,295% 21/10/2030	359.945	0,01				
USD 500.000	Neuberger Berman CLO XVIII 7,745% 21/10/2030	492.485	0,01				
USD 850.000	Neuberger Berman CLO XXII 7,22% 17/10/2030	846.007	0,02				
USD 500.000	Neuberger Berman CLO XXII 7,77% 17/10/2030	497.761	0,01				
USD 1.500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 28 7,188% 20/4/2030	1.485.462	0,03				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 300.000	OHA Credit Partners XI 8,538% 20/1/2032	295.308	0,01	USD 1.357.563	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV 4% 24/8/2049	1.323.121	0,03
USD 1.000.000	OHA Credit Partners XIV 7,095% 21/1/2030	994.430	0,02	USD 8.000.000	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4% 24/8/2040	7.169.651	0,15
USD 1.000.000	OHA Credit Partners XIV 7,395% 21/1/2030	985.555	0,02	USD 6.375.000	Regatta IX Funding 7,37% 17/4/2030	6.368.404	0,13
USD 1.000.000	OHA Loan Funding 2013-1 7,207% 23/7/2031	993.708	0,02	USD 995.000	Regatta VIII Funding 7,27% 17/10/2030	995.095	0,02
USD 1.500.000	OHA Loan Funding 2013-1 7,677% 23/7/2031	1.491.480	0,03	USD 1.000.000	Regatta X Funding 7,37% 17/1/2031	984.681	0,02
USD 750.000	OHA Loan Funding 2013-1 8,657% 23/7/2031	741.060	0,02	USD 750.000	Regatta X Funding 8,32% 17/1/2031	736.710	0,02
USD 500.000	OHA Loan Funding 2013-2 7,489% 23/5/2031	493.423	0,01	USD 1.600.000	Regatta XI Funding 7,22% 17/7/2031	1.590.504	0,03
USD 1.000.000	OZLM XX 7,538% 20/4/2031	969.603	0,02	USD 13.000.000	Regatta XII Funding 6,67% 15/10/2032	12.944.416	0,27
USD 4.500.000	Palmer Square CLO 2018-1 7,022% 18/4/2031	4.466.712	0,09	USD 1.000.000	Regatta XII Funding 8,67% 15/10/2032	984.734	0,02
USD 9.500.000	Palmer Square CLO 2018-2 6,67% 16/7/2031	9.481.830	0,20	USD 1.000.000	Regatta XIII Funding 8,67% 15/7/2031	977.516	0,02
USD 3.000.000	Palmer Square CLO 2018-2 7,22% 16/7/2031	2.983.967	0,06	USD 1.000.000	Regatta XV Funding 8,913% 25/10/2031	987.494	0,02
USD 2.000.000	Palmer Square CLO 2018-2 7,47% 16/7/2031	1.967.050	0,04	USD 3.300.000	Regatta XVI Funding 7,62% 15/1/2033	3.291.761	0,07
USD 3.000.000	Palmer Square CLO 2020-3 7,576% 15/11/2031	2.969.137	0,06	USD 2.250.000	Regatta XVI Funding 8,27% 15/1/2033	2.277.973	0,05
USD 2.250.000	Palmer Square CLO 2020-3 8,576% 15/11/2031	2.224.490	0,05	USD 1.000.000	Riserva CLO 8,822% 18/1/2034	967.477	0,02
USD 2.100.000	Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 7,439% 23/8/2031	2.071.835	0,04	USD 5.805.937	Rockford Tower CLO 2018-1 6,741% 20/5/2031	5.787.068	0,12
USD 6.800.000	Peace Park CLO 7,588% 20/10/2034	6.767.960	0,14	USD 2.900.000	Rockford Tower CLO 2018-1 7,361% 20/5/2031	2.863.823	0,06
USD 2.000.000	Peace Park CLO 8,538% 20/10/2034	1.955.673	0,04	USD 4.600.000	Rockford Tower CLO 2018-2 6,748% 20/10/2031	4.585.050	0,10
USD 7.330.000	Pikes Peak CLO 1 6,787% 24/7/2031	7.283.707	0,15	USD 400.000	Rockford Tower CLO 2018-2 7,788% 20/10/2031	394.488	0,01
USD 5.000.000	Pikes Peak CLO 2 7,322% 18/10/2034	4.928.564	0,10	USD 1.500.000	RR 3 7,37% 15/1/2030	1.470.000	0,03
USD 5.000.000	Pikes Peak CLO 2 7,822% 18/10/2034	4.943.852	0,10	USD 500.000	RR 5 8,67% 15/10/2031	482.310	0,01
USD 500.000	Pikes Peak CLO 3 7,763% 25/10/2034	497.763	0,01	USD 474.000	Sable International Finance 5,75% 7/9/2027	441.375	0,01
USD 2.750.000	Pikes Peak CLO 5 7,288% 20/4/2033	2.721.791	0,06	USD 998.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	1.048.647	0,02
USD 1.000.000	Pikes Peak CLO 6 7,341% 18/5/2034	979.609	0,02	USD 1.337.000	Seagate HDD Cayman 8,5% 15/7/2031	1.401.585	0,03
USD 1.000.000	Pikes Peak CLO 6 7,691% 18/5/2034	973.894	0,02	USD 979.484	Sound Point CLO II 6,682% 26/1/2031	969.070	0,02
USD 1.500.000	Pikes Peak CLO 6 8,741% 18/5/2034	1.471.745	0,03	USD 6.126.000	Sound Point CLO XXI 6,792% 26/10/2031	6.051.059	0,13
USD 1.500.000	Pikes Peak CLO 7 7,403% 25/2/2034	1.477.023	0,03	USD 4.000.000	Southwick Park CLO 7,538% 20/7/2032	3.924.139	0,08
USD 1.000.000	Pikes Peak CLO 7 7,853% 25/2/2034	982.712	0,02	USD 108.498	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	108.617	0,00
USD 5.000.000	Pikes Peak CLO 8 7,338% 20/7/2034	4.935.000	0,10	USD 665.000	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	667.037	0,02
USD 2.400.000	Pikes Peak CLO 8 7,588% 20/7/2034	2.348.354	0,05	USD 525.000	Sunac China 7% 9/7/2025	57.750	0,00
USD 3.400.000	Pikes Peak CLO 8 8,688% 20/7/2034	3.370.468	0,07	USD 1.000.000	Symphony CLO XXVIII 8,757% 23/10/2034	969.625	0,02
USD 4.000.000	Pikes Peak CLO 9 7,369% 27/10/2034	3.954.455	0,08	USD 2.000.000	Tallman Park CLO 7,538% 20/4/2034	1.986.182	0,04
USD 2.000.000	PPM CLO 2018-1 8,82% 15/7/2031	1.883.547	0,04	USD 2.260.563	TICP CLO IX 6,728% 20/1/2031	2.254.986	0,05
USD 1.000.000	PPM CLO 3 7,12% 17/4/2034	976.297	0,02	USD 1.500.000	TICP CLO IX 7,188% 20/1/2031	1.491.763	0,03
USD 1.500.000	PPM CLO 3 8,67% 17/4/2034	1.436.365	0,03	USD 1.000.000	TICP CLO X 8,388% 20/4/2031	982.552	0,02
USD 4.000.000	PPM CLO 4 7,222% 18/10/2034	3.929.644	0,08	USD 1.555.000	TICP CLO XI 6,768% 20/10/2031	1.552.649	0,03
USD 2.000.000	PPM CLO 4 7,672% 18/10/2034	1.961.371	0,04	USD 2.800.000	TICP CLO XI 7,738% 20/10/2031	2.794.698	0,06
USD 1.450.000	PPM CLO 5 7,572% 18/10/2034	1.417.504	0,03	USD 1.740.000	Transocean 7,5% 15/1/2026	1.711.895	0,04
USD 1.250.000	PPM CLO 5 8,622% 18/10/2034	1.202.788	0,03	USD 461.000	Transocean 8% 1/2/2027	448.781	0,01
				USD 2.780.650	Transocean 8,75% 15/2/2030	2.857.529	0,06

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.355.000	Transocean 11,5% 30/1/2027	1.428.150	0,03				
USD 668.000	Transocean Titan Financing 8,375% 1/2/2028	687.206	0,01	EUR 378.000	Côte d'Ivoire Ivory Coast Government International Bond 5,875% 17/10/2031	343.844	0,01
USD 1.000.000	TRESTLES CLO II 8,513% 25/7/2031	1.000.190	0,02	USD 1.779.000	Ivory Coast Government International Bond 6,375% 3/3/2028	1.686.118	0,03
USD 8.000.000	Upland CLO 7,238% 20/4/2031	7.922.726	0,16			2.029.962	0,04
USD 1.500.000	Voya CLO 2015-3 7,288% 20/10/2031	1.483.676	0,03				
USD 500.000	Voya CLO 2016-3 6,762% 18/10/2031	499.375	0,01				
USD 5.200.000	Webster Park CLO 6,938% 20/7/2030	5.123.022	0,11	EUR 175.000	Chypre Bank of Cyprus 2,5% 24/6/2027	169.398	0,00
USD 1.250.000	Webster Park CLO 8,488% 20/7/2030	1.193.950	0,03				
USD 225.000	Wynn Macau 5,5% 15/1/2026	211.186	0,01	EUR 400.000	Danemark Nykredit Realkredit 4,125% 15/4/2026*	397.524	0,01
USD 2.102.000	Wynn Macau 5,625% 26/8/2028	1.846.513	0,04				
		657.622.676	13,59				
	Chili			USD 414.000	République dominicaine Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6,75% 30/3/2029	404.929	0,01
USD 250.000	Celulosa Arauco y Constitucion 3,875% 2/11/2027	228.499	0,00	USD 610.000	Dominican Republic International Bond 4,875% 23/9/2032	517.487	0,01
USD 1.515.000	Chile Government International Bond 3,1% 7/5/2041	1.102.125	0,02	USD 601.000	Dominican Republic International Bond 5,3% 21/1/2041	471.734	0,01
USD 1.499.000	Colbun 3,15% 19/1/2032	1.245.871	0,03	USD 520.000	Dominican Republic International Bond 5,5% 22/2/2029*	486.845	0,01
USD 545.000	Empresa Nacional del Petroleo 6,15% 10/5/2033	539.457	0,01	USD 595.000	Dominican Republic International Bond 5,5% 22/2/2029	557.063	0,01
USD 690.000	Engie Energia Chile 3,4% 28/1/2030	578.337	0,01	USD 852.000	Dominican Republic International Bond 5,95% 25/1/2027	834.095	0,02
USD 456.782	GNL Quintero 4,634% 31/7/2029*	438.502	0,01	USD 545.000	Dominican Republic International Bond 7,05% 3/2/2031*	541.531	0,01
USD 865.000	Nacional del Cobre de Chile 3,625% 1/8/2027	803.204	0,02			3.813.684	0,08
USD 435.000	Nacional del Cobre de Chile 3,75% 15/1/2031	387.231	0,01				
		5.323.226	0,11	EUR 261.000	Égypte Egypt Government International Bond 6,375% 11/4/2031	155.689	0,00
	Colombie						
USD 719.000	Colombia Government International Bond 3,25% 22/4/2032	539.800	0,01				
EUR 203.000	Colombia Government International Bond 3,875% 22/3/2026	212.151	0,00				
USD 929.000	Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	857.337	0,02				
USD 410.000	Colombia Government International Bond 4,125% 15/5/2051	246.410	0,00	EUR 487.000	Finlande Ahlstrom 3 Oy 3,625% 4/2/2028	442.958	0,01
USD 925.000	Colombia Government International Bond 4,5% 28/1/2026	892.708	0,02	EUR 175.000	Finnair 4,25% 19/5/2025	180.252	0,00
USD 1.654.000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033	1.709.840	0,04	USD 482.000	Nordea Bank 6,625% 26/3/2026	457.893	0,01
USD 1.710.000	Ecopetrol 5,375% 26/6/2026*	1.655.049	0,04	EUR 524.000	SBB Treasury 0,75% 14/12/2028	318.963	0,01
USD 788.000	Ecopetrol 5,875% 28/5/2045	551.123	0,01	EUR 430.000	SBB Treasury 1,125% 26/11/2029	258.992	0,00
USD 1.118.000	Ecopetrol 8,875% 13/1/2033	1.131.975	0,02			1.659.058	0,03
USD 905.000	Promigas / Gases del Pacifico 3,75% 16/10/2029	763.368	0,01				
USD 414.000	Promigas / Gases del Pacifico 3,75% 16/10/2029	349.209	0,01	EUR 500.000	France Accor 4,375% 31/1/2024	536.682	0,01
USD 1.326.000	SURA Asset Management 4,875% 17/4/2024	1.311.421	0,03	EUR 200.000	Air France-KLM 1,875% 16/1/2025*	206.534	0,01
		10.220.391	0,21	EUR 300.000	Air France-KLM 8,125% 31/5/2028	339.474	0,01
	Costa Rica			EUR 955.000	Altice France 2,125% 15/2/2025	961.004	0,02
USD 561.000	Costa Rica Government International Bond 6,55% 3/4/2034	566.024	0,01	EUR 207.000	Altice France 3,375% 15/1/2028	157.461	0,00
				USD 202.000	Altice France 5,125% 15/1/2029	144.841	0,00
				USD 878.000	Altice France 5,125% 15/7/2029	624.524	0,01
				USD 3.068.000	Altice France 5,5% 15/10/2029	2.216.102	0,05
				EUR 300.000	Altice France 5,875% 1/2/2027	263.824	0,01
				USD 1.000.000	Altice France 8,125% 1/2/2027	846.032	0,02
				EUR 700.000	Atos 0% 6/11/2024	640.359	0,01
				EUR 400.000	Atos 1,75% 7/5/2025*	357.706	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Île de Man				EUR 450.000	Poste Italiane 2,625% 24/3/2029*	382.036	0,01
USD 897.000	AngloGold Ashanti 3,75% 1/10/2030	746.124	0,02	EUR 929.000	Rekeep 7,25% 1/2/2026*	938.081	0,02
Israël				EUR 1.183.000	Telecom Italia 1,625% 18/1/2029*	1.011.608	0,02
USD 1.227.000	Bank Leumi Le-Israel 3,275% 29/1/2031	1.105.552	0,02	EUR 353.000	Telecom Italia 2,75% 15/4/2025	368.672	0,01
USD 564.000	Bank Leumi Le-Israel 7,129% 18/7/2033	558.289	0,01	EUR 258.000	Telecom Italia 2,875% 28/1/2026	266.472	0,01
USD 981.000	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033	994.489	0,02	EUR 100.000	Telecom Italia 3,625% 25/5/2026	105.434	0,00
USD 796.000	Leviathan Bond 6,75% 30/6/2030	747.420	0,02	EUR 55.000	Telecom Italia 4% 11/4/2024*	59.361	0,00
		3.405.750	0,07	USD 689.000	Telecom Italia 5,303% 30/5/2024	680.806	0,01
Italie				EUR 990.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	1.086.163	0,02
EUR 1.245.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	1.316.306	0,03	EUR 300.000	Telecom Italia 7,875% 31/7/2028	338.796	0,01
EUR 282.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 3,625% 24/9/2024	298.870	0,01	EUR 290.000	UniCredit 2% 23/9/2029	302.049	0,01
EUR 856.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6,75% 2/3/2026	933.143	0,02	EUR 200.000	UniCredit 2,731% 15/1/2032*	194.476	0,00
EUR 1.393.000	Banco BPM 2,875% 29/6/2031	1.352.639	0,03	EUR 500.000	UniCredit 5,375% 3/6/2025*	507.212	0,01
EUR 300.000	Banco BPM 3,25% 14/1/2031	302.700	0,01	USD 765.000	UniCredit 7,296% 2/4/2034	731.947	0,01
EUR 1.235.000	Banco BPM 3,375% 19/1/2032*	1.190.843	0,02	EUR 2.163.000	UniCredit 7,5% 3/6/2026*	2.352.603	0,05
EUR 100.000	Banco BPM 4,25% 1/10/2029	107.003	0,00			30.433.775	0,63
EUR 100.000	Banco BPM 5% 14/9/2030	106.779	0,00	Jamaïque			
EUR 750.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	819.010	0,02	USD 954.000	Digicel International Finance/ Digicel international 8,75% 25/5/2024	873.850	0,02
EUR 304.000	Castor 8,776% 15/2/2029	311.957	0,01	Japon			
EUR 325.000	Cedacri Mergerco 8,424% 15/5/2028*	344.785	0,01	USD 425.000	Mitsubishi UFJ Financial 1,412% 17/7/2025	392.491	0,01
EUR 329.000	Cedacri Mergerco 9,281% 15/5/2028	351.616	0,01	USD 350.000	Mitsubishi UFJ Financial 2,048% 17/7/2030	281.788	0,01
EUR 339.000	Enel 6,375% 16/4/2028*	375.980	0,01	USD 200.000	Mitsubishi UFJ Financial 2,309% 20/7/2032	158.426	0,00
EUR 521.000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11,125% 15/5/2028	565.104	0,01	USD 200.000	Mitsubishi UFJ Financial 3,195% 18/7/2029	176.609	0,00
USD 1.719.000	F-Brasile / F-Brasile US 7,375% 15/8/2026*	1.579.943	0,03	USD 320.000	Mitsubishi UFJ Financial 5,541% 17/4/2026	318.355	0,01
EUR 624.000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027	730.344	0,01	USD 725.000	Nissan Motor 4,345% 17/9/2027	663.291	0,01
EUR 672.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5,625% 1/8/2027	682.848	0,01	EUR 598.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	627.565	0,01
EUR 178.000	IMA Industria Macchine Automatiche 3,75% 15/1/2028	172.896	0,00	EUR 311.000	SoftBank 3,125% 19/9/2025*	320.756	0,01
EUR 321.000	IMA Industria Macchine Automatiche 7,663% 15/1/2028	347.478	0,01	EUR 644.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032*	547.398	0,01
EUR 984.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,625% 21/10/2028	941.568	0,02	EUR 589.000	SoftBank 4% 19/9/2029	550.405	0,01
EUR 639.000	Inter Media and Communication 6,75% 9/2/2027	670.613	0,01	EUR 300.000	SoftBank 4,5% 20/4/2025	319.620	0,01
USD 495.000	Intesa Sanpaolo 4,198% 1/6/2032*	377.770	0,01	EUR 365.000	SoftBank 4,75% 30/7/2025*	388.479	0,01
USD 365.000	Intesa Sanpaolo 4,95% 1/6/2042	243.608	0,00	EUR 101.000	SoftBank 5% 15/4/2028	103.431	0,00
GBP 607.000	Intesa Sanpaolo 5,148% 10/6/2030	646.003	0,01	USD 200.000	Sumitomo Mitsui Financial 1,902% 17/9/2028	168.060	0,00
EUR 821.000	Intesa Sanpaolo 5,5% 1/3/2028*	773.830	0,02	USD 364.000	Sumitomo Mitsui Financial 2,632% 14/7/2026	335.841	0,01
USD 300.000	Intesa Sanpaolo 5,71% 15/1/2026	287.556	0,01	USD 275.000	Sumitomo Mitsui Financial 2,75% 15/1/2030	233.580	0,01
EUR 200.000	Intesa Sanpaolo 5,875% 20/1/2025	209.666	0,00	USD 196.000	Sumitomo Mitsui Financial 3,544% 17/1/2028	180.688	0,00
EUR 2.635.000	Intesa Sanpaolo 7,75% 11/1/2027	2.819.522	0,06	USD 730.000	Sumitomo Mitsui Financial 5,464% 13/1/2026	727.614	0,02
EUR 389.000	Lottomatica 7,6% 1/6/2028	425.646	0,01	USD 200.000	Sumitomo Mitsui Financial 5,52% 13/1/2028	199.774	0,00
EUR 276.000	Lottomatica 9,75% 30/9/2027*	325.002	0,01	USD 200.000	Takeda Pharmaceutical 3,175% 9/7/2050	134.434	0,00
EUR 329.000	Mundys 1,875% 12/2/2028	308.648	0,01	USD 395.000	Takeda Pharmaceutical 5% 26/11/2028	391.387	0,01
EUR 1.400.000	Nexi 0% 24/2/2028	1.188.383	0,02			7.219.992	0,15
				Jersey			
				EUR 80.854	Adient Global 3,5% 15/8/2024	86.373	0,00
				USD 331.000	Aptiv 3,1% 1/12/2051	202.029	0,00
				USD 276.000	Aptiv / Aptiv 3,25% 1/3/2032	234.101	0,01
				USD 4.000.000	Boyce Park CLO 7,084% 21/4/2035	3.922.102	0,08
				USD 3.000.000	Boyce Park CLO 7,434% 21/4/2035	2.932.479	0,06
				USD 5.000.000	CarVal CLO VII-C 7,526% 20/1/2035	5.028.865	0,10
				GBP 100.000	CPUK Finance 3,588% 28/8/2025*	118.966	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
GBP 320.000	CPUK Finance 4,875% 28/8/2025	388.026	0,01	EUR 126.000	Cidron Aida Finco 5% 1/4/2028	125.506	0,00
GBP 795.000	Galaxy Bidco 6,5% 31/7/2026	928.268	0,02	GBP 466.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	522.021	0,01
USD 714.287	Galaxy Pipeline Assets Bidco 2,94% 30/9/2040	564.769	0,01	EUR 588.000	Cirsa Finance International 4,75% 22/5/2025*	631.332	0,01
USD 6.000.000	Golub Capital Partners CLO 66B 6,926% 25/4/2036	6.041.929	0,13	EUR 156.000	Cirsa Finance International 7,875% 31/7/2028	170.404	0,00
GBP 378.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 5,844% 5/11/2031	479.570	0,01	EUR 264.000	Cirsa Finance International 8,185% 31/7/2028	286.209	0,01
USD 7.000.000	Pikes Peak CLO 12 7,037% 20/4/2036	7.058.932	0,15	EUR 381.701	Codere Finance 2 Luxembourg 11% 30/9/2026	310.486	0,01
USD 6.000.000	Pikes Peak CLO 14 2023 7,145% 20/4/2036	6.025.200	0,12	USD 4.772.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	4.529.650	0,09
USD 4.000.000	Pikes Peak CLO 14 2023 7,695% 20/4/2036	4.002.728	0,08	EUR 681.000	Cullinan Holdco Scsp 4,625% 15/10/2026*	619.649	0,01
		38.014.337	0,78	EUR 571.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	635.351	0,01
Kazakhstan				USD 863.000	EIG Pearl 3,545% 31/8/2036	719.039	0,01
USD 339.000	KazMunayGas National JSC 3,5% 14/4/2033	255.945	0,01	USD 1.281.000	EIG Pearl 4,387% 30/11/2046	971.549	0,02
Liberia				EUR 600.000	European TopSoho 4% 21/9/2021***	501.245	0,01
USD 329.000	Royal Caribbean Cruises 4,25% 1/7/2026	307.022	0,01	EUR 458.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	385.032	0,01
USD 620.000	Royal Caribbean Cruises 5,375% 15/7/2027	582.941	0,01	GBP 226.000	Garfunkelux Holdco 3 7,75% 1/11/2025	218.761	0,00
USD 483.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 31/8/2026	464.526	0,01	USD 2.626.000	Herens Holdco 4,75% 15/5/2028	2.019.846	0,04
USD 638.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 1/4/2028	599.648	0,01	EUR 494.000	Herens Midco 5,25% 15/5/2029	288.890	0,01
USD 823.000	Royal Caribbean Cruises 7,25% 15/1/2030	836.125	0,02	USD 758.000	ION Trading Technologies 5,75% 15/5/2028	666.553	0,01
USD 731.000	Royal Caribbean Cruises 8,25% 15/1/2029	764.394	0,02	USD 370.000	Kenbourne Invest 4,7% 22/1/2028	225.700	0,01
USD 1.101.000	Royal Caribbean Cruises 9,25% 15/1/2029	1.173.473	0,02	EUR 824.000	Kleopatra Finco 4,25% 1/3/2026*	744.278	0,02
USD 667.000	Royal Caribbean Cruises 11,625% 15/8/2027	727.510	0,02	EUR 285.000	LHMC Finco 2 7,25% 2/10/2025	308.934	0,01
		5.455.639	0,12	USD 389.000	Medtronic Global 4,25% 30/3/2028	377.686	0,01
Luxembourg				USD 393.000	Medtronic Global 4,5% 30/3/2033	380.327	0,01
EUR 888.000	Adler Financing 12,5% 30/6/2025	994.907	0,02	USD 1.375.000	Millicom International Cellular 4,5% 27/4/2031	1.087.329	0,02
USD 656.000	Albion Financing 1 / Aggreko 6,125% 15/10/2026	619.072	0,01	USD 617.400	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028	556.046	0,01
EUR 346.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3,625% 1/6/2028*	308.271	0,01	EUR 279.000	Monitchem HoldCo 3 8,75% 1/5/2028	300.119	0,01
USD 3.142.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	2.657.822	0,06	USD 844.000	Nexa Resources 5,375% 4/5/2027	789.507	0,02
USD 2.168.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	1.834.646	0,04	USD 1.615.000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	1.487.108	0,03
GBP 156.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,875% 1/6/2028	157.282	0,00	USD 299.000	Puma International Financing 5,125% 6/10/2024	296.306	0,01
EUR 523.000	Altice Financing 2,25% 15/1/2025	543.311	0,01	EUR 599.000	Rossini 6,75% 30/10/2025	655.569	0,01
EUR 189.000	Altice Financing 3% 15/1/2028	159.734	0,00	EUR 876.000	SES 2,875% 27/5/2026	828.902	0,02
EUR 520.000	Altice Financing 4,25% 15/8/2029	431.473	0,01	EUR 417.000	SES 5,625% 29/1/2024	452.739	0,01
USD 243.000	Altice Financing 5% 15/1/2028	197.992	0,00	USD 2.027.000	SK Invictus Intermediate II 5% 30/10/2029*	1.651.349	0,03
USD 3.195.000	Altice Financing 5,75% 15/8/2029	2.534.988	0,05	EUR 250.000	Stena International 7,25% 15/2/2028	280.603	0,00
USD 3.138.129	ARD Finance 6,5% 30/6/2027	2.529.338	0,05	EUR 608.000	Summer BC Holdco B 5,75% 31/10/2026	599.685	0,01
EUR 500.000	Aroundtown 3,375% 23/9/2024*	227.323	0,01	USD 628.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	521.639	0,01
GBP 120.000	Aroundtown 4,75% 25/6/2024	59.387	0,00	USD 1.952.000	Telecom Italia Capital 6,375% 15/11/2033	1.707.841	0,04
USD 1.932.000	Camelot Finance 4,5% 1/11/2026	1.810.489	0,04	USD 59.000	Telecom Italia Capital 7,2% 18/7/2036	53.108	0,00
				USD 287.000	Telecom Italia Capital 7,21% 4/6/2038	264.295	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 269.000	Telecom Italia Finance 7,75% 24/1/2033*	312.253	0,01				
USD 1.600.000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5,5% 1/3/2028*	1.470.400	0,03				
		44.019.281	0,91				
	Malte						
USD 696.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6,375% 1/2/2030	571.061	0,01				
USD 411.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 7,875% 1/5/2027*	372.779	0,01				
		943.840	0,02				
	Îles Marshall						
USD 794.000	Danaos 8,5% 1/3/2028	804.232	0,02				
	Maurice						
USD 2.200.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	1.976.128	0,04				
	Mexique						
USD 200.000	Alpek 3,25% 25/2/2031	162.662	0,01				
USD 350.000	America Movil 3,625% 22/4/2029	319.923	0,01				
USD 250.000	America Movil 4,375% 22/4/2049	210.102	0,00				
USD 622.000	Banco Mercantil del Norte 5,875% 24/1/2027	549.257	0,01				
USD 601.000	BBVA Bancomer 5,125% 18/1/2033	520.229	0,01				
USD 606.000	Cemex 5,125% 8/6/2026	561.928	0,01				
USD 594.000	Comision Federal de Electricidad 4,688% 15/5/2029	541.098	0,01				
USD 588.000	Comision Federal de Electricidad 4,875% 15/1/2024	584.493	0,01				
USD 605.000	Kimberly-Clark de Mexico 2,431% 1/7/2031	508.200	0,01				
USD 520.000	Mexico Government International Bond 3,75% 11/1/2028	493.337	0,01				
USD 1.413.000	Mexico Government International Bond 4,5% 22/4/2029	1.364.880	0,03				
USD 914.000	Mexico Government International Bond 4,75% 8/3/2044	768.523	0,01				
USD 1.009.000	Mexico Government International Bond 6,338% 4/5/2053*	1.005.973	0,02				
USD 280.000	Mexico Government International Bond 6,35% 9/2/2035	290.807	0,01				
EUR 600.000	Petroleos Mexicanos 3,75% 21/2/2024	641.737	0,01				
USD 1.033.000	Petroleos Mexicanos 5,95% 28/1/2031	748.460	0,02				
USD 1.981.000	Petroleos Mexicanos 6,7% 16/2/2032	1.499.815	0,03				
USD 1.719.000	Petroleos Mexicanos 6,75% 21/9/2047	1.069.321	0,02				
USD 245.000	Petroleos Mexicanos 6,875% 4/8/2026	223.652	0,01				
USD 558.000	Petroleos Mexicanos 8,75% 2/6/2029	499.276	0,01				
USD 530.000	Trust Fibra Uno 5,25% 30/1/2026	512.491	0,01				
		13.076.164	0,27				
					Maroc		
USD 628.000	Morocco Government International Bond 2,375% 15/12/2027*	547.632	0,01				
USD 293.000	Morocco Government International Bond 5,95% 8/3/2028	293.413	0,01				
		841.045	0,02				
					Pays-Bas		
EUR 1.100.000	Abertis Infraestructuras Finance 3,248% 24/11/2025	1.083.703	0,02				
EUR 1.500.000	ABN AMRO Bank 4,375% 22/9/2025	1.482.171	0,03				
EUR 400.000	ATF Netherlands 7,078% 20/1/2024	194.118	0,00				
EUR 100.000	Axalta Coating Systems Dutch B 3,75% 15/1/2025	107.461	0,00				
USD 460.000	Braskem Netherlands Finance 7,25% 13/2/2033	437.695	0,01				
USD 2.065.000	Clear Channel International 6,625% 1/8/2025*	2.048.187	0,04				
EUR 1.000.000	Cooperatieve Rabobank 4,625% 29/12/2025	995.166	0,02				
EUR 100.000	Darling Global Finance 3,625% 15/5/2026	106.461	0,00				
USD 108.000	Deutsche Telekom International Finance 8,75% 15/6/2030	127.159	0,00				
USD 1.533.000	Elastic 4,125% 15/7/2029	1.320.099	0,03				
USD 2.024.000	Embraer Netherlands Finance 7% 28/7/2030	2.049.705	0,04				
USD 775.000	Enel Finance International 1,375% 12/7/2026	686.882	0,01				
EUR 340.000	Energizer Gamma Acquisition 3,5% 30/6/2029	302.472	0,01				
EUR 336.000	Global Switch Finance 1,375% 7/10/2030	300.948	0,01				
EUR 100.000	Heimstaden Bostad Treasury 0,625% 24/7/2025	93.546	0,00				
EUR 130.000	Heimstaden Bostad Treasury 1% 13/4/2028	101.589	0,00				
EUR 100.000	Heimstaden Bostad Treasury 1,375% 3/3/2027	86.033	0,00				
USD 6.930.000	ING Groep 3,875% 16/5/2027*	5.163.890	0,11				
USD 200.000	ING Groep 4,1% 2/10/2023	199.721	0,01				
USD 280.000	ING Groep 5,75% 16/11/2026	249.236	0,01				
USD 1.200.000	ING Groep 6,5% 16/4/2025	1.135.010	0,02				
USD 2.461.000	ING Groep 6,75% 16/4/2024	2.409.467	0,05				
EUR 600.000	LeasePlan 7,375% 29/5/2024	639.901	0,01				
USD 296.000	MEGlobal 2,625% 28/4/2028*	261.420	0,01				
USD 435.000	MEGlobal 4,25% 3/11/2026	417.809	0,01				
EUR 600.000	Naturgy Finance 2,374% 23/11/2026	578.384	0,01				
EUR 200.000	Naturgy Finance 3,375% 24/4/2024	213.192	0,01				
EUR 500.000	Nobian Finance 3,625% 15/7/2026*	483.164	0,01				
USD 491.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2,5% 11/5/2031	396.390	0,01				
USD 282.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2,65% 15/2/2032	225.896	0,00				
USD 182.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,25% 11/5/2041	129.683	0,00				
USD 402.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4,3% 18/6/2029	376.487	0,01				
EUR 375.000	OI European 6,25% 15/5/2028	416.151	0,01				
EUR 505.000	OI European 6,25% 15/5/2028	561.603	0,01				
EUR 481.000	Q-Park I 1,5% 1/3/2025*	505.008	0,01				
EUR 145.000	Q-Park I 5,47% 1/3/2026	154.413	0,00				
EUR 575.000	Repsol International Finance 4,247% 11/9/2028*	567.854	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 811.000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	714.110	0,01	USD 605.000	Ziggo Bond 5,125% 28/2/2030	469.543	0,01
USD 281.000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	274.177	0,01	USD 466.000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	434.024	0,01
USD 501.000	Sensata Technologies 5,875% 1/9/2030	474.938	0,01			49.963.369	1,03
USD 34.000	Shell International Finance 3% 26/11/2051	22.826	0,00		Nigéria		
USD 815.000	Siemens Financieringsmaatschappij 2,875% 11/3/2041	599.748	0,01	USD 869.000	Nigeria Government International Bond 7,625% 28/11/2047	596.873	0,01
EUR 644.785	Summer BidCo 9% 15/11/2025	664.890	0,01	USD 583.000	Nigeria Government International Bond 8,375% 24/3/2029	513.774	0,01
EUR 466.663	Summer BidCo 9% 15/11/2025	475.530	0,01			1.110.647	0,02
EUR 700.000	Telefonica Europe 3,875% 22/6/2026*	710.248	0,02		Oman		
EUR 1.400.000	Telefonica Europe 6,135% 3/2/2030	1.486.555	0,03	USD 1.577.000	Oman Government International Bond 6,5% 8/3/2047	1.484.375	0,03
EUR 400.000	Telefonica Europe 7,125% 23/8/2028*	446.737	0,01	USD 586.000	Oman Sovereign Sukuk 4,397% 1/6/2024	577.072	0,01
EUR 276.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3,75% 9/5/2027	274.482	0,01			2.061.447	0,04
EUR 100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4,375% 9/5/2030	94.041	0,00		Panama		
EUR 1.220.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,375% 15/9/2029	1.358.743	0,03	USD 1.269.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 4% 11/8/2041	1.012.368	0,02
EUR 217.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,875% 15/9/2031	246.982	0,01	USD 626.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5,125% 11/8/2061	469.801	0,01
USD 1.762.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3,15% 1/10/2026	1.595.790	0,03	USD 655.082	AES Panama Generation 4,375% 31/5/2030	570.740	0,01
USD 468.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 4,75% 9/5/2027	436.110	0,01	USD 712.000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior 2,375% 14/9/2025	661.633	0,01
USD 413.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 6% 15/4/2024	410.772	0,01	USD 989.000	Banco Nacional de Panama 2,5% 11/8/2030	789.717	0,02
USD 200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 6,75% 1/3/2028	199.657	0,00	USD 1.954.000	Carnival 4% 1/8/2028	1.754.348	0,04
USD 400.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 7,125% 31/1/2025	402.192	0,01	USD 3.594.000	Carnival 5,75% 1/3/2027	3.375.795	0,07
USD 880.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 7,875% 15/9/2029*	918.742	0,02	USD 2.034.000	Carnival 6% 1/5/2029	1.829.000	0,03
USD 882.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 8,125% 15/9/2031	935.674	0,02	USD 481.000	Carnival 7% 15/8/2029	488.887	0,01
USD 1.291.000	Trivium Packaging Finance 5,5% 15/8/2026	1.220.153	0,03	USD 404.000	Carnival 7,625% 1/3/2026	403.091	0,01
EUR 568.000	Trivium Packaging Finance 7,531% 15/8/2026	607.196	0,01	EUR 360.000	Carnival 7,625% 1/3/2026	389.739	0,01
USD 3.171.000	Trivium Packaging Finance 8,5% 15/8/2027	3.010.932	0,06	USD 578.000	Carnival 9,875% 1/8/2027	611.351	0,01
EUR 348.000	United 4% 15/11/2027*	326.014	0,01	USD 1.443.000	Panama Government International Bond 2,252% 29/9/2032	1.094.941	0,02
EUR 205.000	United 7,031% 15/2/2026	217.739	0,00	USD 605.000	Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030*	526.511	0,01
EUR 334.000	UPC 3,875% 15/6/2029	301.917	0,01	USD 501.000	Panama Government International Bond 3,298% 19/1/2033	411.955	0,01
USD 1.436.000	UPC Broadband Finco 4,875% 15/7/2031	1.186.998	0,02	USD 1.337.000	Panama Government International Bond 4,5% 15/5/2047*	1.024.944	0,02
EUR 525.000	VZ Secured Financing 3,5% 15/1/2032	449.480	0,01	USD 855.000	Panama Government International Bond 6,853% 28/3/2054	871.074	0,02
EUR 245.000	VZ Vendor Financing II 2,875% 15/1/2029	207.316	0,00			16.285.895	0,33
EUR 700.000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026	700.208	0,02		Paraguay		
EUR 200.000	ZF Europe Finance 2,5% 23/10/2027	192.261	0,00	USD 397.000	Paraguay Government International Bond 5% 15/4/2026*	388.643	0,01
EUR 839.000	Ziggo 2,875% 15/1/2030	754.376	0,02	USD 945.000	Paraguay Government International Bond 5,6% 13/3/2048	812.114	0,02
USD 635.000	Ziggo 4,875% 15/1/2030	534.194	0,01			1.200.757	0,03
					Pérou		
				USD 1.122.000	Kallpa Generacion 4,875% 24/5/2026	1.078.753	0,02
				USD 614.000	Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031	521.283	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.762.000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034*	1.431.273	0,03	USD 2.134.000	Saudi Government International Bond 3,25% 17/11/2051*	1.412.548	0,03
USD 1.280.000	SAN Miguel Industrias Pet SA / NG PET R&P Latin America 3,5% 2/8/2028	1.088.147	0,02	USD 614.000	Saudi Government International Bond 4,375% 16/4/2029*	597.836	0,01
		4.119.456	0,08	USD 1.200.000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053	1.068.450	0,02
						3.276.682	0,06
	Philippines				Singapour		
USD 812.000	Philippine Government International Bond 2,95% 5/5/2045	562.367	0,01	USD 356.500	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027	332.882	0,01
USD 522.000	Philippine Government International Bond 3,7% 1/3/2041*	419.959	0,01	USD 164.524	JGC Ventures 0% 30/6/2025	33.077	0,00
		982.326	0,02	USD 2.103.197	JGC Ventures 3% 30/6/2025	630.959	0,02
				USD 69.687	Modernland Overseas 3% 30/4/2027	18.810	0,00
				USD 1.673.529	Modernland Overseas 4% 30/4/2027	502.059	0,01
	Pologne			USD 575.000	Pfizer Investment Enterprises 4,65% 19/5/2030	566.436	0,01
USD 612.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375% 22/5/2033	600.525	0,01	USD 689.000	Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	678.690	0,01
USD 305.000	Canpack / Canpack US 3,125% 1/11/2025	283.366	0,01	USD 10.000	Pfizer Investment Enterprises 5,11% 19/5/2043	9.761	0,00
EUR 725.000	Republic of Poland Government International Bond 4,25% 14/2/2043	768.899	0,02	USD 870.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	871.804	0,02
USD 822.000	Republic of Poland Government International Bond 5,5% 4/4/2053	801.113	0,02			3.644.478	0,08
USD 690.000	Republic of Poland Government International Bond 5,75% 16/11/2032*	718.186	0,01				
		3.172.089	0,07		Afrique du Sud		
				USD 900.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,85% 30/9/2029	794.223	0,02
				USD 1.926.000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	1.281.252	0,03
				USD 615.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 20/4/2032	545.745	0,01
						2.621.220	0,06
	Portugal						
EUR 200.000	Banco Espirito Santo 2,625% 8/5/2017***	46.653	0,00		Corée du Sud		
EUR 2.000.000	Banco Espirito Santo 4% 21/1/2019***	466.526	0,01	USD 373.000	POSCO 5,625% 17/1/2026	373.345	0,01
EUR 200.000	Banco Espirito Santo 4,75% 15/1/2018***	46.653	0,00	USD 404.000	POSCO 5,75% 17/1/2028	406.953	0,01
EUR 200.000	EDP - Energias de Portugal 1,7% 20/7/2080*	200.552	0,01	USD 200.000	POSCO 5,875% 17/1/2033	206.239	0,00
EUR 700.000	EDP - Energias de Portugal 1,875% 2/8/2081	679.718	0,01			986.537	0,02
EUR 100.000	EDP - Energias de Portugal 5,943% 23/4/2083	107.627	0,00				
		1.547.729	0,03		Espagne		
				EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 5,875% 24/9/2023	218.653	0,01
	Roumanie			EUR 3.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/3/2024*	3.865.339	0,08
EUR 800.000	RCS & RDS 2,5% 5/2/2025*	832.774	0,02	EUR 1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 15/1/2026	1.032.532	0,02
EUR 1.445.000	Romanian Government International Bond 2,124% 16/7/2031	1.194.348	0,03	EUR 700.000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	707.989	0,02
EUR 974.000	Romanian Government International Bond 2,5% 8/2/2030	884.689	0,02	EUR 2.300.000	Banco de Sabadell 2,5% 15/4/2031	2.230.503	0,05
EUR 1.529.000	Romanian Government International Bond 2,875% 11/3/2029*	1.464.095	0,03	EUR 200.000	Banco de Sabadell 5,25% 7/2/2029	215.703	0,00
USD 1.102.000	Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027	1.083.013	0,02	EUR 600.000	Banco de Sabadell 5,75% 15/3/2026	567.503	0,01
USD 194.000	Romanian Government International Bond 7,625% 17/1/2053	208.975	0,00	EUR 600.000	Banco de Sabadell 6% 16/8/2033	615.489	0,01
		5.667.894	0,12	EUR 1.800.000	Banco Santander 4,375% 14/1/2026	1.642.507	0,03
				EUR 600.000	Banco Santander 5,25% 29/12/2023*	648.526	0,01
	Arabie Saoudite			USD 800.000	Banco Santander 6,921% 8/8/2033	801.531	0,02
USD 200.000	Saudi Arabian Oil 1,25% 24/11/2023	197.848	0,00	USD 600.000	Banco Santander 7,5% 8/2/2024	579.000	0,01
				EUR 1.000.000	Bankinter 7,375% 15/8/2028	1.037.289	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 98.824	Adjustable Rate Mortgage Trust 2005-8 5,989% 25/11/2035	96.136	0,00	USD 2.892.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6,625% 15/7/2026	2.756.326	0,05
USD 652.000	ADT Security 4,875% 15/7/2032	563.365	0,01	USD 2.374.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 9,75% 15/7/2027	2.181.466	0,05
USD 1.692.000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	1.615.325	0,03	USD 9.618.000	Ally Financial 4,7% 15/5/2026	6.774.382	0,14
USD 358.000	Advanced Drainage Systems 6,375% 15/6/2030	354.202	0,01	USD 825.000	Ally Financial 5,75% 20/11/2025	800.283	0,02
USD 40.000	AEP Transmission 3,15% 15/9/2049	27.419	0,00	USD 108.000	Alphabet 1,9% 15/8/2040	72.526	0,00
USD 890.000	AES 1,375% 15/1/2026	800.466	0,02	USD 300.464	Alternative Loan Trust 2005-16 6,075% 25/6/2035	263.806	0,01
USD 203.000	AES 2,45% 15/1/2031	161.315	0,00	USD 554.469	Alternative Loan Trust 2005-61 5,949% 25/12/2035	490.803	0,01
USD 1.898.000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8,25% 15/2/2026	1.909.198	0,04	USD 1.714.556	Alternative Loan Trust 2005-76 5,43% 25/2/2036	1.558.087	0,03
USD 178.000	Aetna 3,875% 15/8/2047	133.730	0,00	USD 1.410.895	Alternative Loan Trust 2006-36T2 6% 25/12/2036	621.415	0,01
USD 208.000	Aetna 4,75% 15/3/2044	179.282	0,00	USD 342.989	Alternative Loan Trust 2006-J7 6,933% 20/11/2046	256.551	0,01
USD 395.000	Ahead DB 6,625% 1/5/2028	341.504	0,01	USD 230.356	Alternative Loan Trust 2006-OA11 5,809% 25/9/2046	214.479	0,00
USD 1.070.000	AHP Health Partners 5,75% 15/7/2029	914.429	0,02	USD 354.339	Alternative Loan Trust 2006-OA14 5,28% 25/11/2046	297.402	0,01
USD 515.000	Air Lease 1,875% 15/8/2026	460.668	0,01	USD 176.534	Alternative Loan Trust 2006-OA14 5,809% 25/11/2046	157.634	0,00
USD 900.000	Air Lease 2,875% 15/1/2026	841.148	0,02	USD 1.106.724	Alternative Loan Trust 2006-OA14 6,16% 25/11/2046	859.909	0,02
USD 373.000	Air Lease 3,375% 1/7/2025	355.534	0,01	USD 977.312	Alternative Loan Trust 2006-OA16 5,809% 25/10/2046	886.753	0,02
USD 205.000	Air Lease 3,75% 1/6/2026	194.846	0,00	USD 1.202.631	Alternative Loan Trust 2006-OA2 5,848% 20/5/2046	1.012.000	0,02
USD 435.000	Alabama Power 3,94% 1/9/2032	396.241	0,01	USD 1.698.585	Alternative Loan Trust 2006-OA3 5,849% 25/5/2036	1.461.737	0,03
USD 1.196.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,25% 15/3/2026	1.113.206	0,02	USD 1.595.292	Alternative Loan Trust 2006-OA8 5,809% 25/7/2046	1.365.321	0,03
USD 263.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,5% 15/3/2029	228.063	0,01	USD 1.184.837	Alternative Loan Trust 2006-OA9 5,628% 20/7/2046	947.551	0,02
USD 190.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,625% 15/1/2027	179.896	0,00	USD 437.592	Alternative Loan Trust 2007-25 6,5% 25/11/2037	212.331	0,00
USD 1.270.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,875% 15/2/2030	1.166.773	0,03	USD 511.603	Alternative Loan Trust 2007-25 6,5% 25/11/2037	248.243	0,01
USD 760.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5,875% 15/2/2028	738.073	0,02	USD 1.562.859	Alternative Loan Trust 2007-9T1 6% 25/5/2037	806.236	0,02
USD 584.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6,5% 15/2/2028	581.682	0,01	USD 2.545.666	Alternative Loan Trust 2007-AL1 5,679% 25/6/2037	2.041.845	0,04
USD 500.000	Alexander Funding Trust II 7,467% 31/7/2028	505.485	0,01	USD 1.875.053	Alternative Loan Trust 2007-OA3 5,709% 25/4/2047	1.656.822	0,03
USD 110.000	Alexandria Real Estate Equities 1,875% 1/2/2033	81.212	0,00	USD 1.443.490	Alternative Loan Trust 2007-OA4 5,769% 25/5/2047	1.235.148	0,03
USD 158.000	Alexandria Real Estate Equities 2,75% 15/12/2029	134.046	0,00	USD 143.820	Alternative Loan Trust 2007-OA7 5,789% 25/5/2047	122.787	0,00
USD 220.000	Alexandria Real Estate Equities 3,55% 15/3/2052	150.534	0,00	USD 994.739	Alternative Loan Trust 2007-OA8 5,789% 25/6/2047	747.871	0,02
USD 982.000	Alexandria Real Estate Equities 3,95% 15/1/2028	920.399	0,02	USD 978.847	Alternative Loan Trust Resecuritization 2006-22R 6% 25/5/2036	571.784	0,01
USD 245.000	Alexandria Real Estate Equities 4,5% 30/7/2029	232.359	0,01	USD 777.000	Alteryx 8,75% 15/3/2028*	751.748	0,02
USD 373.000	Alexandria Real Estate Equities 4,9% 15/12/2030	360.872	0,01	USD 125.000	Altria 2,45% 4/2/2032	97.686	0,00
USD 451.000	Allegiant Travel 7,25% 15/8/2027	441.892	0,01	USD 355.000	Altria 3,7% 4/2/2051	231.439	0,01
USD 2.520.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4,25% 15/10/2027	2.295.188	0,05	USD 93.000	Altria 4,8% 14/2/2029	89.985	0,00
USD 4.838.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 5,875% 1/11/2029	4.236.460	0,09	USD 98.000	Altria 5,95% 14/2/2049	91.673	0,00
USD 6.770.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/10/2027	6.401.038	0,13	USD 80.000	Altria 6,2% 14/2/2059	80.816	0,00
USD 2.149.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/4/2028	2.119.975	0,04	USD 300.000	Amazon.com 1% 12/5/2026	271.025	0,01
USD 3.255.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6% 1/6/2029	2.492.040	0,05	USD 210.000	Amazon.com 1,2% 3/6/2027	184.823	0,00
				USD 386.000	Amazon.com 2,7% 3/6/2060	240.057	0,01
				USD 239.000	Amazon.com 3,15% 22/8/2027	224.602	0,01
				USD 287.000	Amazon.com 3,25% 12/5/2061	199.516	0,00
				USD 212.000	Amazon.com 3,875% 22/8/2037	190.425	0,00
				USD 71.000	Amazon.com 3,95% 13/4/2052	59.313	0,00
				USD 239.000	Amazon.com 4,05% 22/8/2047	206.534	0,00
				USD 155.000	Amazon.com 4,1% 13/4/2062	128.710	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 343.000	AMC Networks 4,25% 15/2/2029	219.311	0,00	USD 868.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,75% 1/3/2027	842.328	0,02
USD 205.000	AMC Networks 4,75% 1/8/2025*	192.114	0,00	USD 140.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,75% 15/1/2028	134.223	0,00
USD 226.000	American Airlines 7,25% 15/2/2028	222.371	0,00	USD 1.048.800	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	953.353	0,02
USD 620.200	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,5% 20/4/2026	609.908	0,01	USD 272.000	Aon 3,75% 2/5/2029	253.111	0,01
USD 1.971.337	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,75% 20/4/2029*	1.894.497	0,04	USD 155.000	Aon / Aon Global 2,05% 23/8/2031	122.696	0,00
USD 482.000	American Builders & Contractors Supply 3,875% 15/11/2029	416.930	0,01	USD 345.000	Aon / Aon Global 2,6% 2/12/2031	283.190	0,01
USD 835.000	American Electric Power 5,699% 15/8/2025	836.239	0,02	USD 255.000	Aon / Aon Global 5,35% 28/2/2033	254.515	0,01
USD 450.000	American Express 3,125% 20/5/2026	425.609	0,01	USD 123.000	Apache 5,35% 1/7/2049	98.824	0,00
USD 696.000	American Express 3,95% 1/8/2025	675.197	0,01	USD 795.000	API DE 4,125% 15/7/2029	687.796	0,01
USD 610.000	American Express 5,625% 28/7/2034*	599.166	0,01	USD 363.000	API DE 4,75% 15/10/2029	328.555	0,01
USD 110.000	American Honda Finance 4,7% 12/1/2028	108.639	0,00	USD 378.000	Apple 2,2% 11/9/2029	330.325	0,01
USD 423.000	American Tower 2,1% 15/6/2030	337.706	0,01	USD 172.000	Apple 2,65% 11/5/2050	114.751	0,00
USD 445.000	American Tower 2,7% 15/4/2031	364.052	0,01	USD 426.000	Apple 2,65% 8/2/2051	283.443	0,01
USD 175.000	American Tower 2,9% 15/1/2030	149.247	0,00	USD 115.000	Apple 2,7% 5/8/2051	76.693	0,00
USD 665.000	American Tower 3,375% 15/10/2026	622.667	0,01	USD 479.000	Apple 3,45% 9/2/2045	388.801	0,01
USD 150.000	American Tower 3,55% 15/7/2027	139.091	0,00	USD 93.000	Apple 3,85% 4/8/2046	78.921	0,00
USD 282.000	American Tower 3,95% 15/3/2029	259.038	0,01	USD 450.000	Apple 3,95% 8/8/2052	381.856	0,01
USD 355.000	American Tower 5,65% 15/3/2033	353.644	0,01	USD 211.000	Apple 4,5% 23/2/2036	211.159	0,00
USD 712.000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9,375% 1/6/2028	728.171	0,02	USD 1.333.000	APX 5,75% 15/7/2029	1.150.833	0,02
USD 268.000	Amgen 2% 15/1/2032	210.366	0,00	USD 727.000	APX 6,75% 15/2/2027	704.247	0,02
USD 66.000	Amgen 2,77% 1/9/2053	39.553	0,00	USD 1.089.000	Aramark Services 5% 1/4/2025	1.076.546	0,02
USD 407.000	Amgen 3% 15/1/2052	265.668	0,01	USD 1.023.000	Aramark Services 5% 1/2/2028	955.588	0,02
USD 25.000	Amgen 3,375% 21/2/2050	17.822	0,00	USD 501.000	Aramark Services 6,375% 1/5/2025*	502.837	0,01
USD 110.000	Amgen 4,2% 22/2/2052	87.807	0,00	USD 307.000	Arches Buyer 4,25% 1/6/2028	267.685	0,01
USD 203.000	Amgen 4,4% 22/2/2062	161.526	0,00	USD 3.738.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,25% 1/4/2028	3.577.827	0,07
USD 465.000	Amgen 4,875% 1/3/2053	413.692	0,01	USD 1.131.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,875% 1/4/2027	1.113.639	0,02
USD 365.000	Amgen 5,15% 2/3/2028	364.365	0,01	USD 1.418.000	Arcosa 4,375% 15/4/2029	1.269.606	0,03
USD 445.000	Amgen 5,25% 2/3/2033	442.862	0,01	EUR 419.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028*	377.586	0,01
USD 295.000	Amgen 5,65% 2/3/2053	293.287	0,01	EUR 373.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029	304.292	0,01
USD 95.000	Amgen 5,75% 2/3/2063	93.898	0,00	USD 4.076.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	3.313.666	0,07
USD 251.000	AMN Healthcare 4% 15/4/2029	214.844	0,00	USD 1.648.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	1.615.675	0,03
USD 621.000	Amsted Industries 5,625% 1/7/2027	603.625	0,01	USD 405.000	Ares Capital 7% 15/1/2027	405.929	0,01
USD 2.040.000	AmWINS 4,875% 30/6/2029	1.831.730	0,04	USD 2.500.000	Ares XXXVR CLO 6,97% 15/7/2030	2.471.224	0,05
USD 115.000	Analog Devices 1,7% 1/10/2028	98.559	0,00	USD 1.000.000	Ares XXXVR CLO 7,47% 15/7/2030	984.015	0,02
USD 110.000	Analog Devices 2,8% 1/10/2041	78.302	0,00	USD 659.000	Arko 5,125% 15/11/2029	542.087	0,01
USD 422.000	ANGI 3,875% 15/8/2028	337.740	0,01	USD 400.000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	407.988	0,01
USD 1.340.000	Anheuser-Busch / Anheuser- Busch InBev Worldwide 4,9% 1/2/2046	1.249.117	0,03	USD 490.000	Asbury Automotive 4,5% 1/3/2028	447.346	0,01
USD 100.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4,439% 6/10/2048	87.753	0,00	USD 430.000	Asbury Automotive 4,75% 1/3/2030	376.961	0,01
USD 140.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4,75% 23/1/2029	138.596	0,00	USD 461.000	Asbury Automotive 5% 15/2/2032	395.162	0,01
USD 40.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4,95% 15/1/2042	38.253	0,00	USD 3.154.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5,875% 30/6/2029	2.874.916	0,06
USD 145.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 5,45% 23/1/2039	147.315	0,00				
USD 140.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 5,55% 23/1/2049	143.669	0,00				
USD 523.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 5,8% 23/1/2059	549.592	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 1.385.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 9% 1/11/2027	1.747.212	0,04	USD 530.152	Banc of America Funding 2007-7 Trust 4,512% 25/9/2037	412.701	0,01
USD 3.082.000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 7,583% 15/4/2035	2.964.010	0,06	USD 581.701	Banc of America Mortgage 2007-4 Trust 6,25% 28/12/2037	468.500	0,01
USD 102.000	Ashland 3,375% 1/9/2031	81.765	0,00	EUR 334.000	Banff Merger Sub 8,375% 1/9/2026	354.146	0,01
USD 834.000	Ashtead Capital 5,95% 15/10/2033	818.739	0,02	USD 171.000	Bank of America 1,658% 11/3/2027	154.497	0,00
USD 324.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	279.401	0,01	USD 200.000	Bank of America 1,922% 24/10/2031	156.762	0,00
USD 565.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/4/2030	482.236	0,01	USD 622.000	Bank of America 2,651% 11/3/2032	509.507	0,01
USD 251.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6,625% 15/1/2028	240.610	0,01	USD 491.000	Bank of America 2,687% 22/4/2032	401.903	0,01
USD 735.783	Asset Backed Home Equity Loan Trust Series 2004-HE9 6,404% 25/12/2034	648.556	0,01	USD 155.000	Bank of America 2,831% 24/10/2051	99.751	0,00
USD 680.000	AT&T 3,5% 1/6/2041	499.296	0,01	USD 225.000	Bank of America 2,884% 22/10/2030	192.961	0,00
USD 109.000	AT&T 3,55% 15/9/2055	70.955	0,00	USD 925.000	Bank of America 2,972% 4/2/2033	760.879	0,02
USD 300.000	AT&T 3,65% 1/6/2051	206.015	0,00	USD 1.503.000	Bank of America 3,419% 20/12/2028	1.377.139	0,03
USD 125.000	AT&T 3,65% 15/9/2059	81.038	0,00	USD 670.000	Bank of America 3,593% 21/7/2028	622.887	0,01
USD 264.000	AT&T 3,8% 1/12/2057	178.377	0,00	USD 600.000	Bank of America 3,974% 7/2/2030	553.147	0,01
USD 600.000	AT&T 4,35% 1/3/2029	567.160	0,01	USD 235.000	Bank of America 4,271% 23/7/2029	221.731	0,00
USD 561.000	AT&T 4,5% 15/5/2035	498.426	0,01	USD 187.000	Bank of America 4,443% 20/1/2048	159.567	0,00
USD 100.000	AT&T 4,65% 1/6/2044	83.163	0,00	USD 210.000	Bank of America 4,571% 27/4/2033	194.754	0,00
USD 6.504.000	AthenaHealth 6,5% 15/2/2030	5.640.274	0,11	USD 168.000	Bank of America 4,75% 21/4/2045	151.275	0,00
USD 381.000	ATI 4,875% 1/10/2029	344.361	0,01	USD 32.000	Bank of America 4,948% 22/7/2028	31.352	0,00
USD 1.525.000	ATI 5,125% 1/10/2031	1.349.717	0,03	USD 191.000	Bank of America 5% 21/1/2044	181.118	0,00
USD 752.000	ATI 5,875% 1/12/2027	732.621	0,02	USD 210.000	Bank of America 5,288% 25/4/2034	205.125	0,00
USD 1.519.000	ATI 7,25% 15/8/2030	1.534.296	0,03	USD 1.480.000	Bank of America 6,204% 10/11/2028	1.512.716	0,03
USD 125.000	Atmos Energy 2,85% 15/2/2052	81.047	0,00	USD 8.391.000	Bank of New York Mellon 3,7% 20/3/2026	7.542.953	0,16
USD 75.000	Atmos Energy 5,75% 15/10/2052	78.399	0,00	USD 400.000	BAT Capital 3,462% 6/9/2029	348.938	0,01
USD 4.760.000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 7,558% 15/12/2036	4.340.596	0,09	USD 85.000	BAT Capital 3,557% 15/8/2027	78.801	0,00
USD 589.000	Autodesk 2,4% 15/12/2031	478.266	0,01	USD 300.000	BAT Capital 4,54% 15/8/2047	218.239	0,00
USD 190.000	AvalonBay Communities 5% 15/2/2033	188.356	0,00	USD 35.000	BAT Capital 4,758% 6/9/2049	25.897	0,00
EUR 290.000	Avantor Funding 2,625% 1/11/2025	299.728	0,01	USD 460.000	BAT Capital 6,421% 2/8/2033	460.274	0,01
USD 1.056.000	Avantor Funding 3,875% 1/11/2029	926.218	0,02	USD 415.000	BAT Capital 7,081% 2/8/2053	410.302	0,01
USD 2.308.000	Avantor Funding 4,625% 15/7/2028	2.143.853	0,04	USD 463.000	Baxter International 2,539% 1/2/2032	372.028	0,01
USD 914.000	Aviation Capital 1,95% 20/9/2026	804.054	0,02	USD 350.000	Bayer US Finance II 4,25% 15/12/2025	338.730	0,01
USD 438.000	Avient 7,125% 1/8/2030	438.975	0,01	USD 1.025.000	Bayer US Finance II 4,375% 15/12/2028	973.219	0,02
USD 593.000	Axalta Coating Systems 3,375% 15/2/2029	503.460	0,01	USD 686.415	Bayview Commercial Asset Trust 2005-2 5,894% 25/8/2035	630.880	0,01
USD 1.438.000	Axalta Coating Systems / Axalta Coating Systems Dutch B 4,75% 15/6/2027	1.353.803	0,03	USD 578.729	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 5,749% 25/11/2035	525.700	0,01
USD 569.000	Azul Secured Finance 11,93% 28/8/2028	566.641	0,01	USD 394.633	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5,679% 25/10/2036	364.737	0,01
USD 915.000	Ball 3,125% 15/9/2031	742.707	0,02	USD 527.494	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 5,759% 25/3/2037	474.589	0,01
USD 630.000	Ball 6% 15/6/2029	620.578	0,01	USD 2.993.335	Bayview Commercial Asset Trust 2007-2 5,699% 25/7/2037	2.656.522	0,06
USD 263.000	Baltimore Gas and Electric 3,2% 15/9/2049	178.624	0,00				
USD 1.620.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,858% 15/11/2032	1.360.111	0,03				
USD 1.980.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 7,358% 15/11/2032	1.631.707	0,03				
USD 6.519.926	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 7,058% 15/9/2034	6.459.528	0,13				

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 803.404	Bayview Commercial Asset Trust 2007-3 5,864% 25/7/2037	711.161	0,01	USD 997.000	Blue Owl Credit Income 7,75% 16/9/2027	990.786	0,02
USD 4.403.171	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 6,104% 25/9/2037	4.033.150	0,08	USD 205.000	Boeing 3,625% 1/3/2048	143.292	0,00
USD 5.595.538	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 6,435% 28/2/2040	4.903.016	0,10	USD 150.000	Boeing 3,65% 1/3/2047	105.309	0,00
USD 980.000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 4,409% 5/8/2038	644.435	0,01	USD 575.000	Boeing 3,75% 1/2/2050	420.274	0,01
USD 35.000.000	BBCMS Trust 2015-SRCH 0,295% 10/8/2035	263.140	0,01	USD 1.145.000	Boeing 5,805% 1/5/2050	1.118.244	0,03
USD 47.523.922	BBCMS Trust 2015-SRCH 1,059% 10/8/2035	1.275.975	0,03	USD 102.000	Boeing 5,93% 1/5/2060	98.765	0,00
USD 668.000	BB-UBS Trust 2012-SHOW 4,16% 5/11/2036	596.628	0,01	USD 843.000	Booz Allen Hamilton 3,875% 1/9/2028	764.479	0,02
USD 1.218.000	BCPE Empire 7,625% 1/5/2027	1.149.062	0,02	USD 800.000	Booz Allen Hamilton 4% 1/7/2029	716.788	0,02
USD 1.940.000	BDS 2022-FL12 7,45% 19/8/2038	1.937.189	0,04	EUR 1.330.000	Boxer Parent 6,5% 2/10/2025	1.433.742	0,03
USD 405.000	Beacon Roofing Supply 4,125% 15/5/2029	349.176	0,01	USD 1.050.000	Boxer Parent 7,125% 2/10/2025	1.052.258	0,02
USD 740.000	Beacon Roofing Supply 6,5% 1/8/2030	729.765	0,02	USD 4.552.000	Boxer Parent 9,125% 1/3/2026	4.559.962	0,09
USD 637.903	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-2 5,869% 25/4/2036	574.662	0,01	USD 296.000	Boyd Gaming 4,75% 1/12/2027	277.595	0,01
USD 607.807	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-AC9 6,25% 25/12/2035	385.130	0,01	USD 641.000	Boyd Gaming 4,75% 15/6/2031	567.099	0,01
USD 894.693	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-AC1 6,25% 25/2/2036	651.999	0,01	USD 1.087.000	Boyne USA 4,75% 15/5/2029	980.981	0,02
USD 606.704	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE7 5,769% 25/9/2036	596.505	0,01	USD 16.000	BP Capital Markets America 1,749% 10/8/2030	12.978	0,00
USD 502.345	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-FS1 5,769% 25/5/2035	495.394	0,01	USD 835.000	BP Capital Markets America 3,06% 17/6/2041	613.079	0,01
USD 381.375	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 5,569% 25/3/2037	343.321	0,01	USD 496.000	BP Capital Markets America 3,588% 14/4/2027	472.883	0,01
USD 783.205	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 5,569% 25/4/2037	1.128.894	0,02	USD 154.000	BP Capital Markets America 3,633% 6/4/2030	142.166	0,00
USD 278.885	Bear Stearns Asset Backed Trust 2004-HE3 5,097% 25/4/2034	271.611	0,01	USD 4.494.000	Brand Industrial Services 10,375% 1/8/2030	4.615.409	0,10
USD 886.639	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 5,569% 25/3/2037	756.837	0,02	USD 141.000	Brink's 5,5% 15/7/2025	138.955	0,00
USD 596.000	Becton Dickinson 3,7% 6/6/2027	563.900	0,01	USD 635.000	Bristol-Myers Squibb 2,9% 26/7/2024	620.548	0,01
USD 39.000	Becton Dickinson 3,734% 15/12/2024	38.055	0,00	USD 360.000	Broadcom 3,187% 15/11/2036	270.820	0,01
USD 998.000	Berry Global 1,57% 15/1/2026	908.018	0,02	USD 600.000	Broadcom 3,419% 15/4/2033	497.853	0,01
USD 5.101.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	5.078.784	0,11	USD 250.000	Broadcom 4,15% 15/4/2032	223.986	0,01
USD 58.000	Blackstone Private Credit Fund 3,25% 15/3/2027	50.561	0,00	USD 805.000	Broadcom 4,926% 15/5/2037	724.224	0,02
USD 302.000	Blackstone Private Credit Fund 7,05% 29/9/2025	303.947	0,01	USD 582.000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGSi Sellco LL 4,5% 1/4/2027	486.662	0,01
USD 2.118.000	Block 2,75% 1/6/2026	1.924.468	0,04	USD 130.000	Buckeye Partners 5,6% 15/10/2044	95.702	0,00
USD 3.814.000	Block 3,5% 1/6/2031	3.136.307	0,07	USD 535.000	Buckeye Partners 5,85% 15/11/2043	413.649	0,01
USD 401.000	Block Communications 4,875% 1/3/2028	332.232	0,01	USD 175.000	Burlington Northern Santa Fe 2,875% 15/6/2052	115.909	0,00
USD 841.000	Blue Owl Capital 3,4% 15/7/2026	757.936	0,02	USD 55.000	Burlington Northern Santa Fe 3,55% 15/2/2050	42.223	0,00
USD 370.000	Blue Owl Capital 3,75% 22/7/2025	346.981	0,01	USD 100.000	Burlington Northern Santa Fe 4,45% 15/3/2043	88.457	0,00
USD 785.000	Blue Owl Credit Income 5,5% 21/3/2025	761.016	0,02	USD 515.000	Burlington Northern Santa Fe 4,9% 1/4/2044	485.350	0,01
				USD 900.000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,633% 10/3/2033	812.297	0,02
				USD 500.000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,717% 10/3/2033	440.266	0,01
				USD 1.591.000	BWX Technologies 4,125% 30/6/2028	1.442.698	0,03
				USD 2.270.000	BXP Trust 2017-CC 3,67% 13/8/2037	1.671.853	0,03
				USD 2.975.000	BXP Trust 2017-CC 3,67% 13/8/2037	2.060.754	0,04
				USD 333.000	Cable One 0% 15/3/2026	275.368	0,01
				USD 1.286.000	Cable One 1,125% 15/3/2028	975.133	0,02
				USD 995.000	Cable One 4% 15/11/2030	776.933	0,02
				USD 930.000	Cablevision Lightpath 3,875% 15/9/2027	774.552	0,02
				USD 1.014.000	Cablevision Lightpath 5,625% 15/9/2028	780.396	0,02
				USD 2.132.000	Caesars Entertainment 4,625% 15/10/2029	1.870.513	0,04
				USD 4.078.000	Caesars Entertainment 6,25% 1/7/2025	4.048.956	0,08

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 3.094.000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	3.100.918	0,06	USD 880.000	CCO / CCO Capital 5,125% 1/5/2027	830.159	0,02
USD 2.173.000	Caesars Entertainment 8,125% 1/7/2027*	2.210.415	0,05	USD 385.000	CCO / CCO Capital 5,375% 1/6/2029	351.929	0,01
USD 617.000	Callon Petroleum 6,375% 1/7/2026	609.503	0,01	USD 2.586.000	CCO / CCO Capital 6,375% 1/9/2029	2.453.995	0,05
USD 3.383.000	Callon Petroleum 7,5% 15/6/2030*	3.330.609	0,07	USD 4.569.000	CCO / CCO Capital 7,375% 1/3/2031	4.545.857	0,09
USD 1.474.000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	1.495.215	0,03	USD 641.000	CD&R Smokey Buyer 6,75% 15/7/2025*	624.719	0,01
USD 2.000	Calpine 4,625% 1/2/2029	1.740	0,00	USD 1.248.000	CDI Escrow Issuer 5,75% 1/4/2030	1.166.177	0,02
USD 328.000	Calpine 5% 1/2/2031	278.338	0,01	USD 337.000	CDW / CDW Finance 3,25% 15/2/2029	293.089	0,01
USD 2.248.000	Calpine 5,125% 15/3/2028	2.055.765	0,04	USD 132.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,375% 15/4/2027	124.685	0,00
USD 125.000	Camden Property Trust 3,15% 1/7/2029	112.315	0,00	USD 1.697.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,5% 1/5/2025	1.685.841	0,04
USD 829.000	Camelot Return Merger Sub 8,75% 1/8/2028	821.887	0,02	USD 154.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 6,5% 1/10/2028	149.105	0,00
USD 350.000	Cameron LNG 3,302% 15/1/2035	290.127	0,01	USD 733.000	Celanese US 6,35% 15/11/2028	734.074	0,02
USD 295.000	Capital One Financial 2,359% 29/7/2032	211.254	0,00	USD 417.000	Celanese US 6,55% 15/11/2030	418.052	0,01
USD 190.000	Capital One Financial 2,618% 2/11/2032	144.893	0,00	USD 592.000	Celanese US 6,7% 15/11/2033	594.465	0,01
USD 705.000	Capital One Financial 2,636% 3/3/2026	665.543	0,01	USD 1.130.000	Centene 2,5% 1/3/2031	899.494	0,02
USD 840.000	Capital One Financial 3,3% 30/10/2024	816.215	0,02	USD 592.000	Centene 3% 15/10/2030	491.931	0,01
USD 350.000	Capital One Financial 3,75% 24/4/2024	344.586	0,01	USD 430.000	Centene 3,375% 15/2/2030	368.213	0,01
USD 115.000	Capital One Financial 3,8% 31/1/2028	105.444	0,00	USD 748.000	Centene 4,625% 15/12/2029	687.898	0,01
USD 2.550.000	Capital One Financial 3,95% 1/9/2026	1.932.063	0,04	USD 207.000	CenterPoint Energy Houston Electric 3% 1/3/2032	177.212	0,00
USD 305.000	Capital One Financial 5,817% 1/2/2034	289.998	0,01	USD 210.000	CenterPoint Energy Houston Electric 4,95% 1/4/2033	206.638	0,00
USD 405.000	Capital One Financial 6,312% 8/6/2029	404.667	0,01	USD 929.000	Central Garden & Pet 4,125% 15/10/2030	800.515	0,02
USD 635.000	Capital One Financial 6,377% 8/6/2034	628.755	0,01	USD 633.000	Central Garden & Pet 5,125% 1/2/2028	595.831	0,01
USD 1.006.000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	991.680	0,02	USD 2.546.000	Central Parent / CDK Global 7,25% 15/6/2029	2.516.126	0,05
USD 123.000	Carpenter Technology 6,375% 15/7/2028	120.331	0,00	USD 1.311.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	1.328.705	0,03
USD 910.000	Carpenter Technology 7,625% 15/3/2030	917.350	0,02	USD 830.000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 4,998% 10/5/2058	749.268	0,02
USD 2.643.337	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE1 5,679% 25/4/2036	2.306.161	0,05	USD 14.214.717	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 1,218% 10/11/2049	364.799	0,01
USD 1.560.257	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 5,689% 25/2/2037	1.449.113	0,03	USD 639.000	Charles Schwab 4% 1/6/2026	551.999	0,01
EUR 697.000	Catalent Pharma Solutions 2,375% 1/3/2028	633.365	0,01	USD 389.000	Charles Schwab 4% 1/12/2030	292.236	0,01
USD 588.000	Catalent Pharma Solutions 3,125% 15/2/2029	494.449	0,01	USD 505.000	Charles Schwab 5,875% 24/8/2026	507.893	0,01
USD 378.000	Catalent Pharma Solutions 3,5% 1/4/2030	318.149	0,01	USD 230.000	Charles Schwab 6,136% 24/8/2034	234.339	0,01
USD 1.247.000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	1.165.590	0,02	USD 2.149.000	Chart Industries 7,5% 1/1/2030	2.207.874	0,05
USD 229.000	CCM Merger 6,375% 1/5/2026	222.507	0,00	USD 352.000	Chart Industries 9,5% 1/1/2031	379.792	0,01
USD 1.832.000	CCO / CCO Capital 4,25% 1/2/2031	1.508.408	0,03	USD 190.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2,8% 1/4/2031	153.214	0,00
USD 737.000	CCO / CCO Capital 4,25% 15/1/2034	565.169	0,01	USD 169.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3,7% 1/4/2051	105.171	0,00
USD 179.000	CCO / CCO Capital 4,5% 15/8/2030	150.903	0,00	USD 115.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3,85% 1/4/2061	68.841	0,00
USD 1.508.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/3/2030	1.301.705	0,03				
USD 1.284.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/2/2032	1.065.996	0,02				
USD 702.000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	647.544	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 231.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3,9% 1/6/2052	148.014	0,00	USD 163.000	Citigroup 3,352% 24/4/2025	159.974	0,00
USD 145.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4,8% 1/3/2050	107.546	0,00	USD 172.000	Citigroup 3,52% 27/10/2028	158.649	0,00
USD 410.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5,125% 1/7/2049	315.716	0,01	USD 265.000	Citigroup 3,785% 17/3/2033	230.509	0,01
USD 75.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5,25% 1/4/2053	59.420	0,00	USD 150.000	Citigroup 3,887% 10/1/2028	141.657	0,00
USD 835.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 6,384% 23/10/2035	809.741	0,02	USD 2.240.000	Citigroup 6,174% 25/5/2034	2.237.922	0,05
USD 18.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 6,484% 23/10/2045	16.557	0,00	USD 1.139.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 5,257% 11/3/2047	1.098.770	0,02
USD 259.000	Chemours 4,625% 15/11/2029	215.530	0,00	USD 720.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1 5,105% 10/5/2049	639.542	0,01
USD 465.000	Chemours 5,75% 15/11/2028	416.751	0,01	USD 1.044.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC37 2,788% 10/4/2049	749.978	0,02
USD 405.000	Cheniere Corpus Christi 5,125% 30/6/2027	400.399	0,01	USD 660.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC37 5,078% 10/4/2049	577.093	0,01
USD 600.000	Cheniere Corpus Christi 5,875% 31/3/2025	597.965	0,01	USD 2.406.000	Civitas Resources 8,375% 1/7/2028	2.473.376	0,05
USD 1.874.000	Cheniere Energy Partners 3,25% 31/1/2032	1.547.967	0,03	USD 1.890.000	Civitas Resources 8,75% 1/7/2031	1.953.526	0,04
USD 1.129.000	Cheniere Energy Partners 4,5% 1/10/2029	1.042.176	0,02	USD 2.507.000	Clarios Global 6,75% 15/5/2025	2.511.643	0,05
USD 380.000	Cheniere Energy Partners 5,95% 30/6/2033	378.854	0,01	EUR 1.040.000	Clarios Global / Clarios US Finance 4,375% 15/5/2026*	1.092.699	0,02
USD 140.000	Chesapeake Energy 5,875% 1/2/2029	134.083	0,00	USD 1.646.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,25% 15/5/2026	1.631.073	0,03
USD 872.000	Chesapeake Energy 6,75% 15/4/2029	866.410	0,02	USD 1.841.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,75% 15/5/2028	1.838.133	0,04
USD 315.893	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-9 6,029% 25/5/2035	252.355	0,01	USD 7.842.000	Clarios Global / Clarios US Finance 8,5% 15/5/2027	7.935.563	0,16
USD 2.887.000	Chobani / Chobani Finance 4,625% 15/11/2028	2.593.130	0,05	USD 3.511.000	Clarivate Science 3,875% 1/7/2028	3.096.280	0,06
USD 3.547.000	Chobani / Chobani Finance 7,5% 15/4/2025	3.541.894	0,07	USD 2.755.000	Clarivate Science 4,875% 1/7/2029	2.406.749	0,05
USD 1.550.000	CHS/Community Health Systems 4,75% 15/2/2031	1.166.220	0,03	USD 383.000	Clean Harbors 4,875% 15/7/2027	366.945	0,01
USD 2.047.000	CHS/Community Health Systems 5,25% 15/5/2030	1.614.974	0,04	USD 415.000	Clean Harbors 6,375% 1/2/2031	413.149	0,01
USD 1.145.000	CHS/Community Health Systems 5,625% 15/3/2027	1.012.536	0,02	USD 2.570.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	2.307.381	0,05
USD 1.776.000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	1.489.407	0,03	USD 1.176.000	Clear Channel Outdoor 7,5% 1/6/2029	877.504	0,02
USD 1.414.000	Churchill Downs 4,75% 15/1/2028	1.306.934	0,03	USD 1.345.000	Clear Channel Outdoor 7,75% 15/4/2028	1.054.125	0,02
USD 1.355.000	Churchill Downs 5,5% 1/4/2027	1.306.547	0,03	USD 2.266.000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	2.277.103	0,05
USD 1.691.000	Churchill Downs 6,75% 1/5/2031	1.649.773	0,03	USD 65.000	Clearway Energy Operating 3,75% 15/2/2031	53.229	0,00
USD 1.050.000	CITGO Petroleum 6,375% 15/6/2026	1.026.049	0,02	USD 1.592.000	Clearway Energy Operating 4,75% 15/3/2028	1.476.738	0,03
USD 969.000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	960.424	0,02	USD 10.833.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	9.689.713	0,20
USD 325.000	Citigroup 2,561% 1/5/2032	261.884	0,01	USD 4.156.000	Cloud Software 9% 30/9/2029	3.716.929	0,08
USD 143.000	Citigroup 2,572% 3/6/2031	118.189	0,00	USD 5.000.000	Clover CLO 2021-3 7,363% 25/1/2035	4.940.889	0,10
USD 503.000	Citigroup 2,666% 29/1/2031	421.715	0,01	USD 5.000.000	Clover CLO 2021-3 7,663% 25/1/2035	4.882.285	0,10
USD 150.000	Citigroup 2,904% 3/11/2042	102.967	0,00	USD 2.409.000	Clydesdale Acquisition 6,625% 15/4/2029	2.295.673	0,05
USD 407.000	Citigroup 2,976% 5/11/2030	349.623	0,01	USD 1.700.000	Clydesdale Acquisition 8,75% 15/4/2030	1.538.136	0,03
USD 383.000	Citigroup 3,2% 21/10/2026	357.120	0,01	USD 931.000	CMG Media 8,875% 15/12/2027	731.279	0,02
				USD 110.000	CMS Energy 4,875% 1/3/2044	97.957	0,00
				USD 851.000	CNX Midstream Partners 4,75% 15/4/2030	735.170	0,02
				USD 370.000	CNX Resources 7,375% 15/1/2031	369.303	0,01
				USD 1.420.000	Coherent 5% 15/12/2029	1.257.557	0,03
				USD 155.000	Columbia Pipelines 6,055% 15/8/2026	156.458	0,00
				USD 169.000	Comcast 1,95% 15/1/2031	136.720	0,00
				USD 85.000	Comcast 2,35% 15/1/2027	77.866	0,00
				USD 355.000	Comcast 2,65% 1/2/2030	308.847	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 710.000	Comcast 2,8% 15/1/2051	451.175	0,01	USD 331.000	Covanta 5% 1/9/2030	281.288	0,01
USD 736.000	Comcast 2,887% 1/11/2051	472.594	0,01	USD 3.000.000	CQP Holdco / BIP-V Chinook Holdco 5,5% 15/6/2031	2.733.231	0,06
USD 510.000	Comcast 3,15% 1/3/2026	486.877	0,01	USD 360.928	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 5,769% 25/7/2037	231.203	0,01
USD 660.000	Comcast 3,75% 1/4/2040	543.455	0,01	USD 2.253.000	Crescent Energy Finance 7,25% 1/5/2026	2.217.046	0,05
USD 120.000	Comcast 4,15% 15/10/2028	115.580	0,00	USD 1.261.000	Crescent Energy Finance 9,25% 15/2/2028	1.290.717	0,03
USD 156.000	Comcast 5,5% 15/11/2032	160.019	0,00	USD 222.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 5,625% 1/5/2027	215.660	0,01
USD 209.000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 4,813% 10/2/2047	184.338	0,00	USD 813.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	791.640	0,01
USD 12.675.000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 0,84% 10/9/2047	95.108	0,00	USD 368.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 7,375% 1/2/2031	378.508	0,01
USD 2.380.000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 4,183% 10/5/2048	2.215.891	0,05	USD 897.000	Crocs 4,125% 15/8/2031	711.680	0,02
USD 3.844.079	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 0,942% 10/8/2048	47.075	0,00	USD 153.000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	131.258	0,00
USD 2.900.000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3,183% 10/2/2048	2.776.995	0,06	USD 419.000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4,75% 1/2/2026	404.454	0,01
USD 2.417.400	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 4,354% 10/2/2048	2.106.322	0,04	USD 335.000	Crown Castle 1,35% 15/7/2025	309.146	0,01
USD 800.000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 3,285% 10/10/2036	620.653	0,01	USD 163.000	Crown Castle 2,25% 15/1/2031	130.993	0,00
USD 92.000	CommonSpirit Health 2,782% 1/10/2030	77.376	0,00	USD 345.000	Crown Castle 2,5% 15/7/2031	278.515	0,01
USD 230.000	CommonSpirit Health 3,347% 1/10/2029	204.741	0,00	USD 316.000	Crown Castle 2,9% 1/4/2041*	213.388	0,00
USD 369.000	CommonSpirit Health 3,91% 1/10/2050	279.287	0,01	USD 225.000	Crown Castle 4,3% 15/2/2029	211.316	0,00
USD 959.000	CommScope 4,75% 1/9/2029	713.334	0,02	USD 220.000	Crown Castle 5,1% 1/5/2033	211.714	0,00
USD 1.283.000	CommScope 6% 1/3/2026	1.163.468	0,02	USD 774.000	Crown Cork & Seal 7,375% 15/12/2026	800.509	0,02
USD 813.000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	743.962	0,02	USD 241.000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	223.209	0,01
USD 594.000	Compass Diversified 5,25% 15/4/2029	545.964	0,01	USD 2.887.000	CrownRock / CrownRock Finance 5,625% 15/10/2025	2.839.076	0,06
USD 1.470.000	Comstock Resources 5,875% 15/1/2030*	1.300.106	0,03	USD 592.000	CSC 4,125% 1/12/2030	422.683	0,01
USD 1.401.000	Comstock Resources 6,75% 1/3/2029*	1.311.375	0,03	USD 683.000	CSC 4,5% 15/11/2031	486.855	0,01
USD 175.000	ConocoPhillips 3,8% 15/3/2052	135.191	0,00	USD 1.687.000	CSC 5,5% 15/4/2027	1.455.907	0,03
USD 90.000	ConocoPhillips 5,05% 15/9/2033	89.568	0,00	USD 4.637.000	CSC 11,25% 15/5/2028	4.577.414	0,09
USD 245.000	ConocoPhillips 5,55% 15/3/2054	245.828	0,01	USD 37.802	CSMC Series 2008-2R 6% 25/7/2037	31.529	0,00
USD 1.511.997	Conseco Finance 6,63% 1/6/2030	1.450.485	0,03	USD 592.887	CSMC Series 2011-4R 6,705% 27/9/2037	482.048	0,01
USD 454.099	Conseco Finance 7,03% 15/7/2028	446.275	0,01	USD 190.000	CSX 3,25% 1/6/2027	178.875	0,00
USD 259.000	Consensus Cloud Solutions 6% 15/10/2026	241.409	0,01	USD 110.000	CSX 4,1% 15/11/2032	103.311	0,00
USD 235.000	Consensus Cloud Solutions 6,5% 15/10/2028*	211.515	0,01	USD 244.000	CSX 4,3% 1/3/2048	205.919	0,00
USD 101.000	Consumers Energy 2,5% 1/5/2060	56.094	0,00	USD 1.289.000	Cushman & Wakefield US Borrower 6,75% 15/5/2028	1.219.980	0,03
USD 130.000	Consumers Energy 3,25% 15/8/2046	93.902	0,00	USD 430.000	Cushman & Wakefield US Borrower 8,875% 1/9/2031	434.786	0,01
USD 240.000	Consumers Energy 3,6% 15/8/2032	215.707	0,00	USD 215.000	CVS Health 1,3% 21/8/2027	184.956	0,00
USD 135.000	Consumers Energy 4,625% 15/5/2033	130.915	0,00	USD 221.000	CVS Health 4,3% 25/3/2028	212.368	0,00
USD 905.000	Consumers Energy 4,9% 15/2/2029	897.262	0,02	USD 570.000	CVS Health 5% 20/2/2026	565.336	0,01
USD 2.959.000	CoreLogic 4,5% 1/5/2028	2.421.646	0,05	USD 363.000	CVS Health 5,125% 20/7/2045	323.427	0,01
EUR 479.000	Coty 3,875% 15/4/2026*	505.517	0,01	USD 50.000	CVS Health 5,625% 21/2/2053	47.551	0,00
USD 68.000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 4,75% 15/1/2029	62.367	0,00	USD 595.000	DAE Funding 1,55% 1/8/2024	569.338	0,01
USD 748.000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030*	745.907	0,02	USD 299.000	DAE Funding 2,625% 20/3/2025	281.384	0,01
USD 636.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	547.580	0,01	USD 305.000	Daimler Truck Finance North America 2% 14/12/2026	274.038	0,01
				USD 1.775.000	Darling Ingredients 6% 15/6/2030	1.738.945	0,04
				USD 1.982.865	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7,606% 15/5/2035	1.932.649	0,04
				USD 4.533.667	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	3.543.864	0,07
				USD 940.000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	730.045	0,02
				USD 1.016.000	DCP Midstream Operating 3,25% 15/2/2032	847.944	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 805.000	Dealer Tire / DT Issuer 8% 1/2/2028*	752.251	0,02	USD 2.472.000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029*	2.209.445	0,05
USD 191.000	Dell International / EMC 6,02% 15/6/2026	192.957	0,00	USD 191.000	DuPont de Nemours 5,319% 15/11/2038	186.936	0,00
USD 2.545.202	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4 5,809% 25/8/2047	2.055.681	0,04	USD 35.000	DuPont de Nemours 5,419% 15/11/2048	33.949	0,00
USD 300.000	Devon Energy 4,5% 15/1/2030	280.428	0,01	USD 911.000	Dycom Industries 4,5% 15/4/2029	814.908	0,02
USD 152.000	Devon Energy 4,75% 15/5/2042	126.790	0,00	USD 1.110.000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	1.133.204	0,02
USD 520.000	Devon Energy 5,25% 15/10/2027	515.832	0,01	USD 916.000	Earthstone Energy 9,875% 15/7/2031	1.002.220	0,02
USD 504.000	Diamondback Energy 3,125% 24/3/2031	433.548	0,01	USD 100.000	Eastman Chemical 4,65% 15/10/2044	81.487	0,00
USD 175.000	Diamondback Energy 3,25% 1/12/2026	164.456	0,00	USD 85.000	Eastman Chemical 4,8% 1/9/2042	72.323	0,00
USD 940.000	Diamondback Energy 3,5% 1/12/2029	849.571	0,02	USD 665.000	Eastman Chemical 5,75% 8/3/2033	656.287	0,01
USD 425.000	Diamondback Energy 4,25% 15/3/2052	319.524	0,01	USD 306.000	Ecolab 2,7% 15/12/2051	194.132	0,00
USD 50.000	Diamondback Energy 6,25% 15/3/2053*	49.768	0,00	USD 480.000	Edison International 5,25% 15/11/2028	468.663	0,01
USD 2.044.000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5,875% 15/8/2027	1.815.849	0,04	USD 13.050.000	Edison International 5,375% 15/3/2026	11.562.079	0,24
USD 375.000	Discover Bank 5,974% 9/8/2028	346.027	0,01	USD 280.000	Edison International 6,95% 15/11/2029	294.846	0,01
USD 8.052.000	Discover Financial Services 5,5% 30/10/2027	6.032.564	0,13	USD 1.350.000	Edison International 8,125% 15/6/2053	1.366.818	0,03
USD 325.000	Discover Financial Services 6,7% 29/11/2032	323.709	0,01	USD 5.613.000	Element Solutions 3,875% 1/9/2028	4.936.159	0,10
USD 191.000	Discovery Communications 3,95% 15/6/2025	184.597	0,00	USD 29.000	Elevance Health 2,375% 15/1/2025	27.741	0,00
USD 1.351.000	DISH DBS 5,125% 1/6/2029	731.702	0,02	USD 105.000	Elevance Health 3,125% 15/5/2050	71.235	0,00
USD 2.193.000	DISH DBS 5,25% 1/12/2026	1.857.245	0,04	USD 148.000	Elevance Health 3,7% 15/9/2049	110.584	0,00
USD 161.000	DISH DBS 5,75% 1/12/2028	125.387	0,00	USD 105.000	Elevance Health 4,65% 15/1/2043	93.425	0,00
USD 2.975.000	DISH Network 11,75% 15/11/2027	3.024.296	0,06	USD 575.000	Elevance Health 4,75% 15/2/2033	557.161	0,01
USD 410.000	Dominion Energy 1,45% 15/4/2026	369.721	0,01	USD 520.000	Elevance Health 5,5% 15/10/2032	530.410	0,01
USD 350.000	Dominion Energy 3,375% 1/4/2030	309.033	0,01	USD 55.000	Elevance Health 6,1% 15/10/2052	58.554	0,00
USD 3.995.000	Dominion Energy 4,35% 15/1/2027	3.414.926	0,07	USD 320.000	Embeta 6,75% 15/2/2030	282.373	0,01
USD 333.000	Dream Finders Homes 8,25% 15/8/2028	337.935	0,01	EUR 510.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	552.832	0,01
USD 993.000	DT Midstream 4,125% 15/6/2029	879.360	0,02	EUR 239.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	259.360	0,01
USD 631.000	DT Midstream 4,375% 15/6/2031	545.117	0,01	USD 8.277.000	Emerald Debt Merger Sub 6,625% 15/12/2030	8.145.080	0,17
USD 110.000	Duke Energy 2,45% 1/6/2030	91.564	0,00	USD 1.038.000	Enact 6,5% 15/8/2025	1.029.462	0,02
USD 200.000	Duke Energy 2,65% 1/9/2026	184.968	0,00	USD 100.000	Enbridge Energy Partners 5,5% 15/9/2040	93.409	0,00
USD 6.950.000	Duke Energy 3,25% 15/1/2082	5.153.709	0,11	USD 54.000	Encompass Health 4,5% 1/2/2028	50.305	0,00
USD 432.000	Duke Energy 3,4% 15/6/2029	390.180	0,01	USD 996.000	Encompass Health 4,625% 1/4/2031	873.132	0,02
USD 350.000	Duke Energy 5% 8/12/2025	346.410	0,01	USD 1.165.000	Encompass Health 4,75% 1/2/2030	1.063.724	0,02
USD 510.000	Duke Energy Carolinas 3,2% 15/8/2049	350.871	0,01	GBP 200.000	Encore Capital 4,25% 1/6/2028	195.538	0,00
USD 225.000	Duke Energy Carolinas 3,7% 1/12/2047	170.582	0,00	EUR 348.000	Encore Capital 4,875% 15/10/2025*	361.097	0,01
USD 533.000	Duke Energy Carolinas 3,95% 15/3/2048	419.735	0,01	GBP 407.000	Encore Capital 5,375% 15/2/2026*	465.222	0,01
USD 125.000	Duke Energy Carolinas 6,05% 15/4/2038	129.811	0,00	USD 130.000	Energy Transfer 4% 1/10/2027	122.067	0,00
USD 1.103.000	Duke Energy Florida 2,5% 1/12/2029	951.211	0,02	USD 120.000	Energy Transfer 4,9% 1/2/2024	119.398	0,00
USD 125.000	Duke Energy Florida 3,85% 15/11/2042	98.909	0,00	USD 572.000	Energy Transfer 5,15% 15/3/2045	483.067	0,01
USD 90.000	Duke Energy Florida 6,4% 15/6/2038	96.972	0,00	USD 130.000	Energy Transfer 5,25% 15/4/2029	126.705	0,00
USD 1.100.000	Duke Energy Progress 3,45% 15/3/2029	1.010.730	0,02	USD 390.000	Energy Transfer 5,55% 15/2/2028	388.681	0,01
USD 332.000	Duke Energy Progress 5,35% 15/3/2053	322.657	0,01	USD 1.280.000	Energy Transfer 5,875% 15/1/2024	1.279.141	0,03
				USD 105.000	Energy Transfer 5,95% 1/10/2043	96.109	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 155.000	Energy Transfer 6% 15/6/2048	143.445	0,00	USD 244.000	FedEx 4,55% 1/4/2046	204.846	0,00
USD 115.000	Energy Transfer 6,125% 15/12/2045	108.196	0,00	USD 1.162.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4,625% 15/1/2029	1.003.318	0,02
USD 825.000	Energy Transfer 6,25% 15/4/2049	790.754	0,02	USD 260.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 6,75% 15/1/2030	215.155	0,00
USD 1.546.000	EnLink Midstream 5,625% 15/1/2028	1.497.276	0,03	USD 110.000	Fidelity National Information Services 1,15% 1/3/2026	98.981	0,00
USD 830.000	EnLink Midstream 6,5% 1/9/2030	833.966	0,02	USD 262.000	Fidelity National Information Services 4,7% 15/7/2027	256.584	0,01
USD 196.000	EnLink Midstream Partners 4,15% 1/6/2025	188.390	0,00	USD 230.000	Fifth Third Bancorp 6,339% 27/7/2029	232.637	0,01
USD 108.000	EnLink Midstream Partners 4,85% 15/7/2026	103.780	0,00	USD 1.279.032	First Franklin Mortgage Loan Trust 2005-FF10 6,129% 25/11/2035	1.175.099	0,03
USD 515.000	EnLink Midstream Partners 5,45% 1/6/2047	427.950	0,01	USD 1.020.608	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5,669% 25/10/2036	681.874	0,01
USD 873.000	EnLink Midstream Partners 5,6% 1/4/2044	734.893	0,02	USD 598.522	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5,749% 25/10/2036	387.727	0,01
USD 392.000	EnPro Industries 5,75% 15/10/2026	382.609	0,01	USD 637.607	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF17 5,579% 25/12/2036	567.413	0,01
USD 392.000	Entegris 4,375% 15/4/2028	359.527	0,01	USD 3.965.006	First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-FF2 5,709% 25/3/2037	2.142.489	0,04
USD 7.140.000	Entegris Escrow 4,75% 15/4/2029	6.635.896	0,13	USD 1.298.000	First-Citizens Bank & Trust 6% 1/4/2036	1.158.979	0,02
USD 438.000	Entegris Escrow 5,95% 15/6/2030	420.209	0,01	USD 545.000	FirstEnergy 2,65% 1/3/2030	455.254	0,01
USD 50.000	Enterprise Products Operating 3,125% 31/7/2029	44.742	0,00	USD 120.000	FirstEnergy 4,15% 15/7/2027*	112.851	0,00
USD 265.000	Enterprise Products Operating 3,3% 15/2/2053	181.858	0,00	USD 43.000	FirstEnergy 5,1% 15/7/2047	37.404	0,00
USD 156.000	Enterprise Products Operating 4,45% 15/2/2043	133.173	0,00	USD 601.000	FirstEnergy Transmission 4,35% 15/1/2025	585.104	0,01
USD 675.000	Enterprise Products Operating 4,8% 1/2/2049	593.958	0,01	USD 326.000	FirstEnergy Transmission 5,45% 15/7/2044	296.763	0,01
USD 105.000	Enterprise Products Operating 4,85% 15/8/2042	94.416	0,00	USD 47.000	Fiserv 2,65% 1/6/2030	39.635	0,00
USD 15.000	Enterprise Products Operating 4,85% 15/3/2044	13.413	0,00	USD 275.000	Fiserv 3,85% 1/6/2025	266.867	0,01
USD 150.000	Enterprise Products Operating 6,45% 1/9/2040	160.303	0,00	USD 108.000	Fiserv 4,4% 1/7/2049	88.462	0,00
USD 75.000	EOG Resources 4,95% 15/4/2050	70.827	0,00	USD 97.000	Florida Power & Light 2,875% 4/12/2051	63.409	0,00
USD 326.000	EQM Midstream Partners 4,125% 1/12/2026	306.417	0,01	USD 222.000	Florida Power & Light 3,7% 1/12/2047	173.470	0,00
USD 65.000	EQM Midstream Partners 4,5% 15/1/2029	59.036	0,00	USD 180.000	Florida Power & Light 4,125% 1/2/2042	152.794	0,00
USD 982.000	EQM Midstream Partners 4,75% 15/1/2031	869.291	0,02	USD 100.000	Florida Power & Light 5,96% 1/4/2039	105.530	0,00
USD 378.000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	374.735	0,01	USD 1.615.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032	1.263.116	0,03
USD 1.677.000	EQM Midstream Partners 6,5% 1/7/2027	1.665.762	0,03	USD 818.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	780.737	0,02
USD 330.000	EQM Midstream Partners 7,5% 1/6/2030	338.811	0,01	GBP 739.000	Ford Motor Credit 2,748% 14/6/2024	902.483	0,02
USD 120.000	EQT 5,7% 1/4/2028	119.488	0,00	USD 266.000	Ford Motor Credit 3,375% 13/11/2025	248.103	0,01
USD 195.000	Equinix 2,5% 15/5/2031	157.811	0,00	USD 400.000	Ford Motor Credit 3,625% 17/6/2031	324.191	0,01
USD 244.000	Equinix 2,9% 18/11/2026	225.399	0,01	USD 200.000	Ford Motor Credit 3,81% 9/1/2024	198.314	0,00
USD 273.000	Equinix 2,95% 15/9/2051	170.458	0,00	USD 607.000	Ford Motor Credit 4,389% 8/1/2026	575.412	0,01
USD 62.000	Equinix 3% 15/7/2050	39.264	0,00	GBP 633.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	767.421	0,02
USD 134.000	Equinix 3,2% 18/11/2029	117.271	0,00	USD 200.000	Ford Motor Credit 4,687% 9/6/2025	192.933	0,00
USD 370.000	Eversource Energy 2,9% 1/3/2027	340.390	0,01	USD 462.000	Ford Motor Credit 5,113% 3/5/2029	425.087	0,01
USD 225.000	Eversource Energy 4,6% 1/7/2027	218.859	0,01	USD 581.000	Ford Motor Credit 5,125% 16/6/2025	565.932	0,01
USD 300.000	Exelon 3,95% 15/6/2025	291.020	0,01	EUR 620.000	Ford Motor Credit 6,125% 15/5/2028*	690.741	0,01
USD 125.000	Exelon 4,05% 15/4/2030	115.611	0,00				
USD 75.000	Exelon 4,7% 15/4/2050	63.819	0,00				
USD 15.000	Exelon 5,1% 15/6/2045	13.670	0,00				
USD 88.000	Expedia 6,25% 1/5/2025	88.392	0,00				
USD 1.725.000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	1.578.625	0,03				
USD 479.000	FedEx 3,1% 5/8/2029	428.838	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 3.844.000	Ford Motor Credit 6,8% 12/5/2028*	3.844.865	0,08	USD 344.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7,75% 1/2/2028	335.678	0,00
GBP 647.000	Ford Motor Credit 6,86% 5/6/2026*	800.572	0,02	USD 588.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8,875% 15/4/2030	585.462	0,01
USD 400.000	Ford Motor Credit 6,95% 10/6/2026	400.384	0,01	USD 750.000	Georgia Power 4,7% 15/5/2032	715.976	0,02
USD 2.116.000	Ford Motor Credit 7,2% 10/6/2030	2.142.463	0,04	USD 133.000	Georgia-Pacific 1,75% 30/9/2025	123.185	0,00
USD 300.000	Ford Motor Credit 7,35% 4/11/2027	305.605	0,01	USD 650.000	Gilead Sciences 2,8% 1/10/2050	420.002	0,01
USD 2.151.000	Ford Motor Credit 7,35% 6/3/2030	2.191.832	0,05	USD 344.000	Gilead Sciences 4,5% 1/2/2045	302.608	0,01
USD 577.000	Fortrea 7,5% 1/7/2030	570.076	0,01	USD 230.000	Gilead Sciences 4,75% 1/3/2046	209.521	0,00
USD 2.158.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 5,5% 1/5/2028	2.009.378	0,04	USD 500.000	Glencore Funding 5,7% 8/5/2033	489.997	0,01
USD 1.819.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 6,5% 1/10/2025	1.799.727	0,04	USD 878.000	Global Net Lease / Global Net Lease Operating Partnership 3,75% 15/12/2027	686.278	0,01
USD 721.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 9,75% 1/8/2027	750.265	0,02	USD 805.000	Global Payments 1,2% 1/3/2026	720.189	0,01
USD 238.000	Foundation Building Materials 6% 1/3/2029	201.473	0,00	USD 850.000	Global Payments 3,2% 15/8/2029	739.754	0,02
USD 5.209.796	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,474% 25/3/2026	152.445	0,00	USD 50.000	Global Payments 4,15% 15/8/2049	36.629	0,00
USD 180.000	Freeport-McMoRan 5,4% 14/11/2034	170.659	0,00	USD 1.312.000	Global Payments 5,4% 15/8/2032	1.284.505	0,03
USD 900.000	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust 4,19% 25/5/2025	863.980	0,02	USD 80.000	Global Payments 5,95% 15/8/2052	76.487	0,00
USD 755.000	FREMF 2018-K80 Mortgage Trust 4,376% 25/8/2050	706.899	0,01	USD 799.000	GLP Capital / GLP Financing II 3,25% 15/1/2032	644.472	0,01
USD 2.456.000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	2.105.246	0,04	USD 185.000	GLP Capital / GLP Financing II 4% 15/1/2030	161.159	0,00
USD 593.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	540.378	0,01	USD 979.000	Go Daddy Operating / GD Finance 5,25% 1/12/2027	935.855	0,02
USD 3.339.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	3.241.493	0,07	USD 790.000	Goldman Sachs 1,431% 9/3/2027	708.230	0,02
USD 303.000	FTAI Infra Escrow 10,5% 1/6/2027	303.428	0,01	USD 218.000	Goldman Sachs 1,992% 27/1/2032	169.914	0,00
USD 851.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	907.570	0,02	USD 134.000	Goldman Sachs 2,383% 21/7/2032	105.940	0,00
USD 808.000	Gartner 4,5% 1/7/2028	754.587	0,02	USD 717.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	580.740	0,01
USD 549.000	Gates Global / Gates 6,25% 15/1/2026	545.368	0,01	USD 420.000	Goldman Sachs 2,65% 21/10/2032	337.237	0,01
USD 413.000	GCI 4,75% 15/10/2028	358.742	0,01	USD 511.000	Goldman Sachs 4,223% 1/5/2029	481.067	0,01
USD 515.000	GE HealthCare Technologies 5,55% 15/11/2024	513.570	0,01	USD 43.000	Goldman Sachs 5,15% 22/5/2045	39.619	0,00
USD 84.000	General Electric 8,882% 15/9/2023	84.191	0,00	USD 700.000	Goldman Sachs 5,7% 1/11/2024	698.754	0,01
USD 84.000	General Mills 3% 1/2/2051	56.658	0,00	USD 115.000	Goldman Sachs 6,75% 1/10/2037	122.425	0,00
USD 269.000	General Mills 4,95% 29/3/2033	262.302	0,01	USD 556.000	Goodyear Tire & Rubber 5,625% 30/4/2033	477.732	0,01
USD 504.000	General Motors 4% 1/4/2025	490.116	0,01	USD 106.000	GrafTech Finance 4,625% 15/12/2028	83.207	0,00
USD 104.000	General Motors 5,4% 1/4/2048	86.948	0,00	USD 1.033.000	GrafTech Global Enterprises 9,875% 15/12/2028*	1.002.403	0,02
USD 40.000	General Motors 5,6% 15/10/2032	38.488	0,00	USD 374.000	Graphic Packaging International 3,5% 15/3/2028	333.720	0,01
USD 81.000	General Motors 5,95% 1/4/2049	72.801	0,00	USD 76.000	Graphic Packaging International 4,75% 15/7/2027	72.278	0,00
USD 303.000	General Motors 6,25% 2/10/2043	284.650	0,01	USD 423.000	Gray Television 5,875% 15/7/2026	387.498	0,01
USD 675.000	General Motors Financial 4,35% 9/4/2025	658.265	0,01	USD 254.000	Gray Television 7% 15/5/2027	228.309	0,01
USD 185.000	General Motors Financial 6% 9/1/2028	185.424	0,00	USD 968.067	Greenpoint Manufactured Housing 8,14% 20/3/2030	701.263	0,02
USD 344.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 6,5% 1/10/2025	339.166	0,01	USD 228.070	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR1 5,599% 25/2/2036	197.043	0,00
				USD 247.730	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 6,43% 25/3/2036	218.517	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 454.000	Greystar Real Estate Partners 7,75% 1/9/2030	458.268	0,01	USD 196.000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4,875% 1/4/2027	189.296	0,00
USD 500.000	GS Mortgage II Series 2005- ROCK 5,862% 3/5/2032	450.781	0,01	USD 99.000	Home Depot 3,35% 15/4/2050	72.649	0,00
USD 355.000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 4,554% 10/7/2048	318.143	0,01	USD 65.000	Home Depot 3,9% 15/6/2047	53.009	0,00
USD 331.807	GSAA Home Equity Trust 2005- 14 6,129% 25/12/2035	145.784	0,00	USD 168.000	Home Depot 4,2% 1/4/2043	146.528	0,00
USD 1.134.756	GSAA Home Equity Trust 2006- 5 5,789% 25/3/2036	374.510	0,01	USD 100.000	Home Depot 4,25% 1/4/2046	85.881	0,00
USD 2.112.061	GSAMP Trust 2006-FM3 5,569% 25/11/2036	1.006.507	0,02	USD 222.000	Home Depot 4,5% 6/12/2048	198.788	0,00
USD 843.756	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP3 3,816% 25/9/2035	771.061	0,02	USD 3.961.000	Home Point Capital 5% 1/2/2026*	3.713.831	0,08
USD 631.000	GTCR AP Finance 8% 15/5/2027	624.915	0,01	USD 395.000	Howard Hughes 4,125% 1/2/2029	325.275	0,01
USD 154.500	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	157.040	0,00	USD 604.000	Howard Hughes 4,375% 1/2/2031	480.791	0,01
USD 1.106.000	GYP III 4,625% 1/5/2029	973.944	0,02	USD 277.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	250.152	0,01
USD 116.000	H&E Equipment Services 3,875% 15/12/2028	101.559	0,00	USD 780.000	Howard Midstream Energy Partners 8,875% 15/7/2028	802.425	0,02
USD 136.000	Halliburton 2,92% 1/3/2030	118.576	0,00	USD 17.000	Howmet Aerospace 5,125% 1/10/2024	16.841	0,00
USD 131.000	Halliburton 3,8% 15/11/2025	127.379	0,00	USD 805.000	HP 2,2% 17/6/2025	758.266	0,02
USD 150.000	Halliburton 5% 15/11/2045	135.161	0,00	USD 214.000	HP 3% 17/6/2027	196.745	0,00
USD 421.000	Hanesbrands 4,875% 15/5/2026	394.286	0,01	USD 3.372.051	HSI Asset Loan Obligation Trust 2007-WF1 4,367% 25/12/2036	1.057.045	0,02
USD 1.714.000	Hanesbrands 9% 15/2/2031*	1.721.638	0,04	USD 2.385.000	HUB International 7% 1/5/2026	2.383.389	0,05
USD 35.000	Hartford Financial Services 2,9% 15/9/2051	22.259	0,00	USD 4.503.000	HUB International 7,25% 15/6/2030	4.564.020	0,09
USD 159.000	Harvest Midstream I 7,5% 1/9/2028	159.637	0,00	USD 274.000	Hughes Satellite Systems 5,25% 1/8/2026	250.163	0,01
USD 1.323.000	HAT I / HAT II 3,375% 15/6/2026	1.188.289	0,02	USD 635.000	Hyundai Capital America 0,8% 8/1/2024	624.080	0,01
USD 67.000	HCA 3,5% 1/9/2030	58.555	0,00	USD 300.000	Hyundai Capital America 0,875% 14/6/2024	288.352	0,01
USD 370.000	HCA 3,5% 15/7/2051	246.958	0,01	USD 245.000	Hyundai Capital America 1% 17/9/2024	233.023	0,01
USD 405.000	HCA 3,625% 15/3/2032	348.319	0,01	USD 1.339.000	Hyundai Capital America 1,8% 15/10/2025	1.234.639	0,03
USD 350.000	HCA 4,625% 15/3/2052	281.267	0,01	USD 75.000	Hyundai Capital America 5,8% 26/6/2025	75.049	0,00
USD 273.000	HCA 5% 15/3/2024	271.528	0,01	USD 1.587.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4,375% 1/2/2029	1.256.071	0,03
USD 51.000	HCA 5,25% 15/6/2049	44.670	0,00	USD 1.919.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5,25% 15/5/2027	1.682.144	0,04
USD 809.000	HCA 5,375% 1/9/2026	802.490	0,02	USD 880.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6,25% 15/5/2026	817.175	0,02
USD 2.017.000	HealthEquity 4,5% 1/10/2029*	1.790.110	0,04	USD 7.671.000	ILFC E-Capital Trust I 7,064% 21/12/2065	5.568.343	0,12
USD 30.000	Healthpeak 2,875% 15/1/2031	25.166	0,00	USD 5.107.000	ILFC E-Capital Trust II 7,314% 21/12/2065	3.747.261	0,08
USD 163.000	Healthpeak 3,5% 15/7/2029	146.317	0,00	USD 1.681.000	Illuminate Buyer / Illuminate IV 9% 1/7/2028*	1.557.909	0,03
USD 305.000	Healthpeak 5,25% 15/12/2032	294.535	0,01	USD 2.562.000	Imola Merger 4,75% 15/5/2029	2.281.971	0,05
USD 310.000	HEICO 5,35% 1/8/2033	307.402	0,01	USD 1.194.554	Impac CMB Trust Series 2005-6 5,929% 25/10/2035	1.035.488	0,02
USD 300.000	Helios Software / ION Corporate Solutions Finance 4,625% 1/5/2028	259.059	0,01	USD 625.283	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 5,609% 25/8/2037	577.309	0,01
USD 1.547.000	Herc 5,5% 15/7/2027	1.490.052	0,03	USD 222.000	Ingevity 3,875% 1/11/2028	188.247	0,00
USD 490.000	Hertz 4,625% 1/12/2026	442.360	0,01	USD 498.000	Installed Building Products 5,75% 1/2/2028	468.116	0,01
USD 400.000	Hertz 5% 1/12/2029	329.115	0,01	USD 57.000	Intel 2,8% 12/8/2041	39.638	0,00
USD 1.189.000	Hess 4,3% 1/4/2027	1.143.204	0,02	USD 190.000	Intel 5,625% 10/2/2043	189.233	0,00
USD 365.000	Hess 5,6% 15/2/2041	344.364	0,01	USD 410.000	Intel 5,7% 10/2/2053	406.933	0,01
USD 175.000	Hess 5,8% 1/4/2047	167.248	0,00	USD 290.000	Intel 5,9% 10/2/2063	291.465	0,01
USD 245.000	Hess Midstream Operations 4,25% 15/2/2030	214.635	0,01	USD 100.000	Intercontinental Exchange 1,85% 15/9/2032	76.182	0,00
USD 182.000	Hewlett Packard Enterprise 4,45% 2/10/2023	181.788	0,00				
USD 380.000	HF Sinclair 2,625% 1/10/2023	378.972	0,01				
USD 756.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5,75% 1/2/2029	702.022	0,01				
USD 408.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6,25% 1/11/2028	393.150	0,01				
USD 574.000	Hilton Domestic Operating 3,75% 1/5/2029	506.643	0,01				
USD 778.000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	674.711	0,01				
USD 256.000	Hilton Domestic Operating 5,375% 1/5/2025	254.432	0,01				
USD 575.000	Hilton Domestic Operating 5,75% 1/5/2028	564.648	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 101.000	Intercontinental Exchange 3,1% 15/9/2027	93.439	0,00	USD 87.000	JPMorgan Chase 5,4% 6/1/2042	87.018	0,00
USD 72.000	Intercontinental Exchange 4,25% 21/9/2048	60.580	0,00	USD 128.000	JPMorgan Chase 5,625% 16/8/2043	127.549	0,00
USD 175.000	Intercontinental Exchange 4,6% 15/3/2033	167.511	0,00	USD 7.284.000	JPMorgan Chase 6,626% 15/5/2047	6.219.374	0,13
USD 40.000	Intercontinental Exchange 5,2% 15/6/2062	37.790	0,00	USD 3.000.000	Juniper Valley Park CLO 7,005% 20/7/2035	3.002.384	0,06
USD 100.000	International Business Machines 2,85% 15/5/2040	71.114	0,00	USD 178.000	K Hovnanian Enterprises 7,75% 15/2/2026	176.338	0,00
USD 100.000	International Business Machines 4,15% 15/5/2039	85.957	0,00	USD 1.627.000	Kaiser Aluminum 4,5% 1/6/2031	1.314.651	0,03
USD 97.000	Interpublic of 3,375% 1/3/2041	68.451	0,00	USD 1.064.000	Kaiser Aluminum 4,625% 1/3/2028	938.545	0,02
USD 1.470.617	Invitation Homes 2018-SFR4 Trust 6,525% 17/1/2038	1.470.621	0,03	USD 113.000	Kaiser Foundation Hospitals 2,81% 1/6/2041	80.671	0,00
USD 650.000	Invitation Homes Operating Partnership 5,5% 15/8/2033	629.710	0,01	USD 257.000	KB Home 7,25% 15/7/2030	259.197	0,01
USD 973.000	IQVIA 5% 15/10/2026	941.623	0,02	USD 19.000	KBR 4,75% 30/9/2028	17.136	0,00
USD 200.000	IQVIA 5% 15/5/2027	192.299	0,00	USD 327.000	Ken Garff Automotive 4,875% 15/9/2028	284.806	0,01
USD 477.000	IQVIA 6,5% 15/5/2030	480.001	0,01	USD 155.000	Keurig Dr Pepper 4,5% 15/4/2052	131.881	0,00
USD 642.000	Iron Mountain 5,625% 15/7/2032	576.826	0,01	USD 150.000	Kilroy Realty 3,05% 15/2/2030	119.887	0,00
USD 1.667.000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	1.665.919	0,03	USD 322.000	Kilroy Realty 4,75% 15/12/2028	290.072	0,01
USD 882.000	Iron Mountain Information Management Services 5% 15/7/2032	763.051	0,02	USD 540.000	Kimco Realty 4,6% 1/2/2033	496.617	0,01
USD 1.447.000	ITT 6,5% 1/8/2029	1.314.585	0,03	USD 100.000	Kinder Morgan 3,6% 15/2/2051	67.481	0,00
USD 2.000.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-NINE 2,949% 6/9/2038	1.687.608	0,04	USD 175.000	Kinder Morgan 5,55% 1/6/2045	158.327	0,00
USD 1.398.000	Jefferies Finance / JFIN Co-Issuer 5% 15/8/2028	1.199.808	0,03	USD 405.000	Kinder Morgan Energy Partners 5% 1/3/2043	343.645	0,01
USD 603.000	JELD-WEN 4,625% 15/12/2025	584.084	0,01	USD 250.000	Kinder Morgan Energy Partners 5,4% 1/9/2044	217.795	0,01
USD 191.000	John Deere Capital 3,9% 7/6/2032	178.174	0,00	USD 155.000	Kinder Morgan Energy Partners 6,375% 1/3/2041	153.453	0,00
USD 720.000	Johns Hopkins University 4,705% 1/7/2032	712.549	0,02	USD 522.000	Kinetik 5,875% 15/6/2030	505.377	0,01
USD 765.000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CH1 6,229% 25/7/2036	645.437	0,01	USD 354.000	KLA 3,3% 1/3/2050	255.528	0,01
USD 1.471.618	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C22 0,945% 15/9/2047	5.875	0,00	USD 646.000	KLA 4,1% 15/3/2029	620.340	0,01
USD 357.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 4,29% 15/12/2048	269.832	0,01	USD 1.009.000	Kobe US Midco 2 9,25% 1/11/2026	737.831	0,02
USD 10.120.000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0,75% 15/12/2049	196.691	0,00	USD 383.000	Kontoor Brands 4,125% 15/11/2029	325.255	0,01
USD 29.999.000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2017-C5 0,415% 15/3/2050	324.385	0,01	USD 1.710.000	Korn Ferry 4,625% 15/12/2027	1.592.082	0,03
USD 906.000	JPMorgan Chase 1,47% 22/9/2027	800.645	0,02	USD 686.000	Kraft Heinz Foods 4,875% 1/10/2049	609.040	0,02
USD 1.273.000	JPMorgan Chase 2,182% 1/6/2028	1.130.236	0,02	USD 50.000	Kraft Heinz Foods 5,5% 1/6/2050	48.421	0,00
USD 748.000	JPMorgan Chase 2,963% 25/1/2033	622.066	0,01	EUR 743.000	Kronos International 3,75% 15/9/2025	734.701	0,02
USD 120.000	JPMorgan Chase 3,157% 22/4/2042	88.402	0,00	USD 805.000	LABL 5,875% 1/11/2028	729.445	0,01
USD 1.014.000	JPMorgan Chase 3,882% 24/7/2038	854.996	0,02	USD 1.265.000	LABL 9,5% 1/11/2028	1.303.761	0,03
USD 766.000	JPMorgan Chase 4,005% 23/4/2029	717.973	0,02	USD 468.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,25% 1/2/2027	423.746	0,01
USD 180.000	JPMorgan Chase 4,95% 1/6/2045	165.572	0,00	USD 205.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,75% 15/6/2029	172.499	0,00
USD 1.060.000	JPMorgan Chase 5,299% 24/7/2029	1.053.768	0,02	USD 142.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5,25% 1/10/2025	136.824	0,00
				USD 133.000	Lam Research 2,875% 15/6/2050	89.103	0,00
				USD 280.000	Lam Research 3,75% 15/3/2026	271.493	0,01
				USD 23.000	Lam Research 4,875% 15/3/2049	21.636	0,00
				USD 1.110.000	Lamb Weston 4,125% 31/1/2030	978.655	0,02
				USD 429.000	Lamb Weston 4,375% 31/1/2032	371.600	0,01
				USD 1.307.000	Lamb Weston 4,875% 15/5/2028	1.236.278	0,03
				USD 909.000	LCM Investments II 4,875% 1/5/2029	789.713	0,02

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 732.000	LCM Investments II 8,25% 1/8/2031	733.047	0,02	USD 507.000	LSF11 A5 HoldCo 6,625% 15/10/2029	423.355	0,01
USD 753.000	Legacy LifePoint Health 4,375% 15/2/2027	651.345	0,01	USD 10.838.546	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 0,955% 10/3/2050	178.508	0,00
USD 225.000	Legends Hospitality Co / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	209.452	0,00	USD 1.125.000	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 4,829% 10/3/2050	906.479	0,02
USD 417.141	Lehman XS Trust Series 2007-20N 7,729% 25/12/2037	419.950	0,01	USD 1.301.000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	814.354	0,02
USD 3.155.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	2.888.596	0,06	USD 250.000	LYB International Finance III 1,25% 1/10/2025	227.964	0,00
USD 273.000	Level 3 Financing 3,625% 15/1/2029	162.774	0,00	USD 1.105.000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4,108% 15/8/2034	937.869	0,02
USD 2.960.000	Level 3 Financing 4,625% 15/9/2027	2.229.740	0,05	USD 1.897.000	Madison IAQ 5,875% 30/6/2029	1.598.161	0,03
USD 2.909.000	Level 3 Financing 10,5% 15/5/2030	2.956.578	0,06	USD 125.000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	121.271	0,00
EUR 2.312.000	Liberty Mutual 3,625% 23/5/2059	2.394.362	0,05	USD 646.000	MajorDrive IV 6,375% 1/6/2029	530.069	0,01
USD 2.075.000	Liberty Mutual 4,125% 15/12/2051	1.672.025	0,03	USD 267.000	Marathon Oil 4,4% 15/7/2027	254.217	0,01
USD 1.314.000	Life Time 5,75% 15/1/2026	1.282.666	0,03	USD 125.000	Marathon Petroleum 4,75% 15/9/2044	103.611	0,00
USD 966.000	Life Time 8% 15/4/2026*	964.986	0,02	USD 86.000	Marsh & McLennan 2,375% 15/12/2031	70.028	0,00
USD 1.020.000	LifePoint Health 9,875% 15/8/2030	1.006.839	0,02	USD 235.000	Marsh & McLennan 3,75% 14/3/2026	227.110	0,01
USD 789.344	Ligado Networks 15,5% 1/11/2023	274.302	0,01	USD 295.000	Marsh & McLennan 4,375% 15/3/2029	285.230	0,01
USD 189.000	Light & Wonder International 7,25% 15/11/2029	189.406	0,00	USD 155.000	Mastercard 3,35% 26/3/2030	142.566	0,00
USD 554.000	Light & Wonder International 7,5% 1/9/2031	561.688	0,01	USD 41.000	Mastercard 3,85% 26/3/2050	34.115	0,00
USD 1.270.000	Lindblad Expeditions 6,75% 15/2/2027	1.231.405	0,03	USD 558.824	Mastr Asset Backed Trust 2006-AM2 5,949% 25/6/2036	485.702	0,01
USD 790.000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	812.483	0,02	USD 819.000	Matador Resources 5,875% 15/9/2026	799.290	0,02
USD 1.030.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	623.412	0,01	USD 718.000	Matador Resources 6,875% 15/4/2028	718.874	0,02
USD 364.000	Lithia Motors 3,875% 1/6/2029	312.914	0,01	USD 611.000	Match II 3,625% 1/10/2031	496.987	0,01
USD 94.000	Live Nation Entertainment 3,75% 15/1/2028	83.929	0,00	USD 610.000	Match II 4,125% 1/8/2030	523.781	0,01
USD 2.081.000	Live Nation Entertainment 4,75% 15/10/2027*	1.932.909	0,04	USD 1.005.000	Match II 4,625% 1/6/2028	926.851	0,02
USD 88.000	Live Nation Entertainment 4,875% 1/11/2024	86.502	0,00	USD 280.000	Match II 5,625% 15/2/2029	264.251	0,01
USD 55.000	Live Nation Entertainment 5,625% 15/3/2026	53.394	0,00	USD 612.000	Mattel 5,45% 1/11/2041	527.605	0,01
USD 4.282.000	Live Nation Entertainment 6,5% 15/5/2027	4.287.969	0,09	USD 872.000	Mattel 6,2% 1/10/2040	815.397	0,02
USD 478.197	Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-3 5,949% 25/8/2045	459.604	0,01	USD 9.231.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	9.079.899	0,19
USD 3.818.704	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-4 5,729% 25/5/2036	2.171.147	0,05	USD 292.000	Mauser Packaging Solutions 9,25% 15/4/2027	265.131	0,01
USD 3.032.031	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 5,729% 25/7/2036	1.210.421	0,03	USD 2.931.000	McAfee 7,375% 15/2/2030	2.567.503	0,05
USD 1.634.505	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 5,739% 25/8/2036	859.215	0,02	USD 1.886.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	1.643.590	0,03
USD 2.313.560	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-WL3 6,029% 25/1/2036	2.059.562	0,04	USD 4.502.000	Medline Borrower 5,25% 1/10/2029	4.008.869	0,09
USD 444.000	Lowe's 3% 15/10/2050	282.268	0,01	USD 185.000	Memorial Health Services 3,447% 1/11/2049	134.663	0,00
USD 72.000	Lowe's 3,5% 1/4/2051	49.592	0,00	USD 575.000	Mercedes-Benz Finance North America 5,5% 27/11/2024	574.073	0,01
USD 1.709.000	Lowe's 3,65% 5/4/2029	1.585.826	0,03	USD 150.000	Merck 1,45% 24/6/2030	121.064	0,00
USD 148.000	Lowe's 3,7% 15/4/2046	110.900	0,00	USD 354.000	Merck 2,15% 10/12/2031	289.349	0,01
USD 155.000	Lowe's 4,25% 1/4/2052	122.845	0,00	USD 382.000	Merck 2,75% 10/12/2051	250.451	0,01
USD 155.000	Lowe's 4,45% 1/4/2062	120.913	0,00	USD 175.000	Merck 4,5% 17/5/2033	170.624	0,00
USD 120.000	Lowe's 4,65% 15/4/2042	104.965	0,00	USD 145.000	Merck 5% 17/5/2053	141.746	0,00
USD 140.000	Lowe's 5,625% 15/4/2053	136.342	0,00	USD 590.000	Meritage Homes 5,125% 6/6/2027	567.412	0,01
				USD 470.000	Meta Platforms 3,85% 15/8/2032	431.408	0,01
				USD 10.000	Meta Platforms 4,95% 15/5/2033	9.949	0,00
				USD 270.000	Meta Platforms 5,6% 15/5/2053	272.619	0,01
				USD 286.000	Metis Merger Sub 6,5% 15/5/2029	248.976	0,01
				USD 3.903.000	MetLife 3,85% 15/9/2025	3.608.716	0,07

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 394.000	MGIC Investment 5,25% 15/8/2028	376.046	0,01	USD 780.000	Morgan Stanley Capital I 2017- HR2 2,73% 15/12/2050	474.824	0,01
USD 113.000	MGM Resorts International 5,75% 15/6/2025	111.637	0,00	USD 3.400.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UBS9 1,747% 15/3/2049	119.362	0,00
USD 537.000	Microsoft 2,525% 1/6/2050	356.121	0,01	USD 1.590.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 5,013% 15/7/2051	1.284.674	0,03
USD 729.000	Microsoft 2,921% 17/3/2052	518.110	0,01	USD 1.175.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	796.303	0,02
USD 150.000	Microsoft 3,45% 8/8/2036	133.462	0,00	USD 1.700.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 8,23% 15/7/2035	1.671.211	0,03
USD 1.796.000	MicroStrategy 6,125% 15/6/2028	1.608.984	0,03	USD 223.000	Motorola Solutions 2,75% 24/5/2031	180.951	0,00
USD 137.000	Mid-America Apartments 3,6% 1/6/2027	129.622	0,00	USD 214.000	Motorola Solutions 4,6% 23/5/2029	205.834	0,00
USD 100.000	MidAmerican Energy 3,15% 15/4/2050	67.811	0,00	USD 100.000	Mount Nittany Medical Center Obligated 3,799% 15/11/2052	75.433	0,00
USD 450.000	MidAmerican Energy 3,65% 15/4/2029	418.962	0,01	USD 412.000	MPLX 1,75% 1/3/2026	374.978	0,01
USD 350.000	MidAmerican Energy 4,25% 15/7/2049	288.338	0,01	USD 470.000	MPLX 4,95% 14/3/2052	388.215	0,01
USD 465.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance 5,375% 15/8/2027	439.295	0,01	USD 130.000	MPLX 5,5% 15/2/2049	116.035	0,00
USD 330.000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4,875% 1/5/2029	287.405	0,01	USD 45.000	MPLX 5,65% 1/3/2053	40.827	0,00
USD 1.721.909	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6,5% 20/6/2027	1.717.201	0,04	GBP 660.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2,5% 24/3/2026	657.476	0,01
USD 425.000	Minerals Technologies 5% 1/7/2028	388.775	0,01	GBP 330.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2,55% 5/12/2023	404.706	0,01
USD 1.082.000	ModivCare 5,875% 15/11/2025	1.027.748	0,02	USD 1.605.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 3,5% 15/3/2031	1.041.563	0,02
USD 2.105.000	Molina Healthcare 3,875% 15/11/2030	1.800.458	0,04	USD 1.858.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4,625% 1/8/2029	1.346.039	0,03
USD 152.000	Molina Healthcare 4,375% 15/6/2028	139.964	0,00	USD 1.188.947	MSCG Trust 2018-SELF 7,508% 15/10/2037	1.163.925	0,02
USD 431.000	Morgan Stanley 0,79% 30/5/2025	413.240	0,01	USD 196.000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	173.146	0,00
USD 657.000	Morgan Stanley 1,593% 4/5/2027	589.472	0,01	USD 21.000	Murphy Oil 5,75% 15/8/2025	20.800	0,00
USD 205.000	Morgan Stanley 1,928% 28/4/2032	158.177	0,00	USD 100.000	Murphy Oil 5,875% 1/12/2042	84.350	0,00
USD 37.000	Morgan Stanley 2,188% 28/4/2026	34.871	0,00	USD 695.000	Murphy Oil USA 4,75% 15/9/2029	634.585	0,01
USD 364.000	Morgan Stanley 2,699% 22/1/2031	306.413	0,01	USD 2.559.000	Nabors Industries 5,75% 1/2/2025	2.511.902	0,05
USD 62.000	Morgan Stanley 2,802% 25/1/2052	39.385	0,00	USD 322.000	Nabors Industries 7,375% 15/5/2027	315.157	0,01
USD 86.000	Morgan Stanley 3,217% 22/4/2042	63.549	0,00	USD 305.000	Nasdaq 5,55% 15/2/2034	304.174	0,01
USD 475.000	Morgan Stanley 3,62% 17/4/2025	467.709	0,01	USD 573.000	Nationstar Mortgage 5,125% 15/12/2030	484.080	0,01
USD 273.000	Morgan Stanley 3,622% 1/4/2031	242.659	0,01	USD 444.000	Nationstar Mortgage 5,75% 15/11/2031	381.205	0,01
USD 479.000	Morgan Stanley 3,772% 24/1/2029	443.968	0,01	USD 602.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	573.953	0,01
USD 2.300.000	Morgan Stanley 4,21% 20/4/2028	2.198.777	0,05	USD 70.000	Nationwide Children's Hospital 4,556% 1/11/2052	64.179	0,00
USD 535.000	Morgan Stanley 4,431% 23/1/2030	507.205	0,01	USD 8.875.000	Natixis Commercial Mortgage Trust 2017-75B 0,109% 10/4/2037	17.240	0,00
USD 350.000	Morgan Stanley 4,679% 17/7/2026	342.588	0,01	USD 13.537.000	Natixis Commercial Mortgage Trust 2017-75B 0,335% 10/4/2037	105.949	0,00
USD 610.000	Morgan Stanley 5,123% 1/2/2029	597.519	0,01	USD 803.000	Navient 5,5% 15/3/2029	687.374	0,01
USD 275.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	273.087	0,01	USD 41.000	Navient 7,25% 25/9/2023	41.061	0,00
USD 12.675.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 1,452% 15/10/2048	311.320	0,01	USD 484.000	Navient 9,375% 25/7/2030	485.399	0,01
USD 7.096.876	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 0,793% 15/12/2049	122.580	0,00	USD 486.000	NCR 5% 1/10/2028	446.336	0,01
				USD 1.441.000	NCR 5,125% 15/4/2029	1.310.507	0,03
				USD 1.133.000	Neptune Bidco US 9,29% 15/4/2029	1.056.423	0,03
				USD 634.000	NESCO II 5,5% 15/4/2029	576.315	0,01
				USD 500.000	Netflix 4,875% 15/4/2028	492.168	0,01
				USD 665.000	Netflix 4,875% 15/6/2030	645.783	0,01
				USD 430.000	New Enterprise Stone & Lime 5,25% 15/7/2028	397.125	0,01

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 353.000	New Enterprise Stone & Lime 9,75% 15/7/2028	350.279	0,01	USD 2.180.000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4,75% 30/4/2027	1.902.758	0,04
USD 1.440.000	New Fortress Energy 6,5% 30/9/2026	1.339.234	0,03	USD 415.000	Northwest Florida Timber Finance 4,75% 4/3/2029	381.075	0,01
USD 2.522.000	New Fortress Energy 6,75% 15/9/2025	2.440.401	0,05	USD 175.000	Northwestern University 4,643% 1/12/2044	166.293	0,00
USD 342.000	Newmont 2,8% 1/10/2029	294.763	0,01	USD 1.922.000	Novelis 3,25% 15/11/2026	1.744.399	0,04
USD 88.000	NextEra Energy Capital 2,44% 15/1/2032	70.552	0,00	USD 2.624.000	Novelis 3,875% 15/8/2031	2.175.433	0,05
USD 233.000	NextEra Energy Capital 3,55% 1/5/2027	219.497	0,01	USD 2.304.000	Novelis 4,75% 30/1/2030	2.067.167	0,04
USD 10.660.000	NextEra Energy Capital 3,8% 15/3/2082	8.998.624	0,19	USD 340.000	NRG Energy 2,45% 2/12/2027	288.468	0,01
USD 1.295.000	NextEra Energy Capital 4,2% 20/6/2024	1.277.788	0,03	USD 650.000	NRG Energy 7% 15/3/2033	642.187	0,01
USD 390.000	NextEra Energy Capital 5,749% 1/9/2025	391.115	0,01	USD 77.000	Nucor 2% 1/6/2025	72.436	0,00
USD 140.000	NextEra Energy Capital 6,051% 1/3/2025	140.527	0,00	USD 345.000	Nucor 3,95% 23/5/2025	335.453	0,01
USD 18.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/9/2024	17.291	0,00	USD 1.338.000	NuStar Logistics 5,75% 1/10/2025	1.312.934	0,03
USD 2.164.000	NFP 4,875% 15/8/2028	1.933.990	0,04	USD 321.000	NVIDIA 3,5% 1/4/2040	267.344	0,01
USD 6.463.000	NFP 6,875% 15/8/2028*	5.695.086	0,12	USD 302.411	Oakwood Mortgage Investors 5,9% 15/9/2022***	139.507	0,00
USD 420.000	NFP 7,5% 1/10/2030	408.627	0,01	USD 514.011	Oakwood Mortgage Investors 7,415% 15/1/2029	487.907	0,01
USD 692.000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7,5% 1/2/2026	687.607	0,01	USD 125.000	Occidental Petroleum 4,2% 15/3/2048	91.982	0,00
USD 200.000	NiSource 0,95% 15/8/2025	183.184	0,00	USD 666.000	Occidental Petroleum 6,2% 15/3/2040	656.606	0,01
USD 125.000	NiSource 3,6% 1/5/2030	111.912	0,00	USD 474.000	Occidental Petroleum 6,45% 15/9/2036	483.708	0,01
USD 125.000	NiSource 3,95% 30/3/2048	95.773	0,00	USD 535.000	Occidental Petroleum 7,5% 1/5/2031	579.804	0,01
USD 50.000	NiSource 5% 15/6/2052	44.495	0,00	USD 1.000.000	OHA Credit Partners XII 7,507% 23/7/2030	987.719	0,02
USD 205.000	NiSource 5,25% 30/3/2028	204.073	0,00	USD 175.000	Ohio Power 1,625% 15/1/2031	136.931	0,00
USD 286.000	NiSource 5,4% 30/6/2033	283.567	0,01	USD 263.000	Ohio Power 2,6% 1/4/2030	222.947	0,01
USD 500.000	Nissan Motor Acceptance 1,85% 16/9/2026	432.842	0,01	USD 38.000	Ohio Power 2,9% 1/10/2051	24.256	0,00
USD 400.000	NMG / Neiman Marcus 7,125% 1/4/2026	380.371	0,01	USD 335.000	Ohio Power 4% 1/6/2049	263.055	0,01
USD 963.000	Noble Finance II 8% 15/4/2030	996.847	0,02	USD 340.000	Ohio Power 5% 1/6/2033	331.441	0,01
USD 220.000	Norfolk Southern 3,05% 15/5/2050	147.110	0,00	USD 2.761.000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 4,077% 10/5/2039	1.900.614	0,04
USD 145.000	Norfolk Southern 3,155% 15/5/2055	96.015	0,00	EUR 822.000	Olympus Water US 9,625% 15/11/2028*	893.345	0,02
USD 96.000	Norfolk Southern 3,4% 1/11/2049	68.126	0,00	USD 1.733.000	Olympus Water US 9,75% 15/11/2028	1.747.283	0,04
USD 95.000	Norfolk Southern 3,7% 15/3/2053	70.769	0,00	USD 335.000	Oncor Electric Delivery 2,75% 15/5/2030	289.634	0,01
USD 145.000	Norfolk Southern 3,8% 1/8/2028	136.647	0,00	USD 287.000	Oncor Electric Delivery 3,75% 1/4/2045	226.477	0,01
USD 100.000	Norfolk Southern 3,942% 1/11/2047	79.284	0,00	USD 111.000	Oncor Electric Delivery 4,1% 15/11/2048	91.069	0,00
USD 215.000	Norfolk Southern 4,15% 28/2/2048	176.929	0,00	USD 35.000	Oncor Electric Delivery 5,3% 1/6/2042	34.399	0,00
USD 320.000	Norfolk Southern 4,45% 1/3/2033	303.283	0,01	USD 547.000	OneMain Finance 3,5% 15/1/2027	474.412	0,01
USD 195.000	Norfolk Southern 5,05% 1/8/2030	192.889	0,00	USD 72.000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	56.147	0,00
USD 180.000	Norfolk Southern 5,35% 1/8/2054	175.209	0,00	USD 258.000	OneMain Finance 5,375% 15/11/2029	224.444	0,01
USD 2.888.000	Northern Oil and Gas 8,125% 1/3/2028	2.897.560	0,06	USD 1.250.000	OneMain Finance 6,625% 15/1/2028	1.171.429	0,02
USD 1.037.000	Northern Oil and Gas 8,75% 15/6/2031	1.060.058	0,02	USD 1.577.000	OneMain Finance 6,875% 15/3/2025	1.570.780	0,03
USD 155.000	Northern States Power 2,6% 1/6/2051	95.112	0,00	USD 715.000	OneMain Finance 7,125% 15/3/2026	704.775	0,01
USD 100.000	Northern States Power 2,9% 1/3/2050	65.966	0,00	USD 230.000	ONEOK 6,625% 1/9/2053	232.860	0,01
USD 195.000	Northern States Power 4,5% 1/6/2052	168.596	0,00	USD 1.742.000	Option Care Health 4,375% 31/10/2029	1.534.482	0,03
USD 625.000	Northern Trust 6,125% 2/11/2032	637.575	0,01	USD 194.000	Oracle 2,95% 1/4/2030	168.067	0,00
				USD 200.000	Oracle 3,6% 1/4/2040	151.643	0,00
				USD 867.000	Oracle 3,6% 1/4/2050	600.727	0,01
				USD 260.000	Oracle 3,65% 25/3/2041	196.861	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 311.000	Oracle 3,85% 15/7/2036	257.809	0,01	USD 2.144.000	Paramount Global 6,375% 30/3/2062	1.773.410	0,04
USD 112.000	Oracle 3,85% 1/4/2060	76.424	0,00	USD 150.000	Parker-Hannifin 4,5% 15/9/2029	144.879	0,00
USD 365.000	Oracle 3,95% 25/3/2051	266.666	0,01	USD 790.000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4,5% 15/8/2028	721.370	0,02
USD 115.000	Oracle 4% 15/7/2046	86.413	0,00	USD 168.000	PayPal 1,65% 1/6/2025	157.389	0,00
USD 263.000	Oracle 4% 15/11/2047	196.732	0,00	USD 287.000	PayPal 2,65% 1/10/2026	267.168	0,01
USD 359.000	Oracle 4,125% 15/5/2045	277.923	0,01	USD 12.000	PayPal 3,25% 1/6/2050	8.543	0,00
USD 191.000	Oracle 5,375% 15/7/2040	178.692	0,00	USD 160.000	PayPal 4,4% 1/6/2032	153.023	0,00
USD 135.000	Oracle 5,55% 6/2/2053	125.888	0,00	USD 389.000	PBF / PBF Finance 7,875% 15/9/2030	388.411	0,01
USD 115.000	Oracle 5,8% 10/11/2025	116.066	0,00	USD 69.000	PDC Energy 5,75% 15/5/2026	68.957	0,00
EUR 399.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2,875% 30/4/2028	385.210	0,01	USD 62.000	PECO Energy 2,85% 15/9/2051	39.298	0,00
USD 1.600.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4,125% 30/4/2028	1.448.346	0,03	USD 180.000	PECO Energy 4,375% 15/8/2052	153.770	0,00
USD 1.658.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5,125% 30/4/2031	1.414.126	0,03	USD 545.000	PECO Energy 4,9% 15/6/2033	535.930	0,01
USD 433.000	OT Merger 7,875% 15/10/2029	286.943	0,01	USD 512.000	Penske Automotive 3,5% 1/9/2025	489.027	0,01
USD 65.000	Otis Worldwide 2,565% 15/2/2030	55.621	0,00	USD 1.402.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	1.350.544	0,03
USD 100.000	Otis Worldwide 5,25% 16/8/2028	100.621	0,00	USD 168.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4,2% 1/4/2027	158.150	0,00
USD 1.455.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,25% 15/1/2029	1.194.947	0,02	USD 455.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 5,875% 15/11/2027	452.180	0,01
USD 216.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	175.770	0,00	USD 737.000	Performance Food 4,25% 1/8/2029	649.670	0,01
USD 1.473.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	1.334.612	0,03	USD 288.000	Permian Resources Operating 5,375% 15/1/2026	279.043	0,01
USD 640.000	Ovintiv 5,65% 15/5/2025	638.140	0,01	USD 1.769.000	Permian Resources Operating 5,875% 1/7/2029	1.711.958	0,04
USD 805.000	Ovintiv 5,65% 15/5/2028	798.787	0,02	USD 256.000	Permian Resources Operating 6,875% 1/4/2027	254.578	0,01
USD 101.000	Owens-Brockway Glass Container 6,625% 13/5/2027	100.067	0,00	USD 767.000	Permian Resources Operating 7,75% 15/2/2026	775.652	0,02
USD 599.000	Owens-Brockway Glass Container 7,25% 15/5/2031	602.264	0,01	USD 411.000	PetSmart / PetSmart Finance 4,75% 15/2/2028	369.158	0,01
USD 210.000	Pacific Gas and Electric 2,5% 1/2/2031	164.336	0,00	USD 2.084.000	PetSmart / PetSmart Finance 7,75% 15/2/2029	1.992.180	0,04
USD 455.000	Pacific Gas and Electric 3,3% 1/12/2027	405.214	0,01	USD 65.000	Pfizer 2,55% 28/5/2040	46.647	0,00
USD 620.000	Pacific Gas and Electric 3,45% 1/7/2025	588.626	0,01	USD 130.000	Pfizer 3,45% 15/3/2029	121.825	0,00
USD 345.000	Pacific Gas and Electric 3,5% 1/8/2050	217.557	0,01	USD 30.000	Pfizer 4,3% 15/6/2043	27.072	0,00
USD 290.000	Pacific Gas and Electric 3,75% 1/7/2028	260.920	0,01	USD 120.000	Pfizer 7,2% 15/3/2039	145.121	0,00
USD 110.000	Pacific Gas and Electric 4% 1/12/2046	73.095	0,00	USD 110.000	Pharmacia 6,6% 1/12/2028	118.400	0,00
USD 200.000	Pacific Gas and Electric 4,45% 15/4/2042	148.169	0,00	USD 20.000	Philip Morris International 1,5% 1/5/2025	18.754	0,00
USD 341.000	Pacific Gas and Electric 4,95% 1/7/2050	264.803	0,01	USD 220.000	Philip Morris International 5,625% 17/11/2029	222.121	0,01
USD 210.000	Pacific Gas and Electric 5,25% 1/3/2052	167.011	0,00	USD 310.000	Phillips 66 3,3% 15/3/2052	205.445	0,00
USD 720.000	Pacific Gas and Electric 6,1% 15/1/2029	711.310	0,02	USD 155.000	Pioneer Natural Resources 1,125% 15/1/2026	140.426	0,00
USD 1.050.000	Pacific Gas and Electric 6,4% 15/6/2033	1.039.253	0,02	USD 428.000	Pioneer Natural Resources 1,9% 15/8/2030	345.520	0,01
USD 190.000	Pacific Gas and Electric 6,7% 1/4/2053	185.486	0,00	USD 290.000	Pioneer Natural Resources 5,1% 29/3/2026	287.582	0,01
USD 223.000	Pacific Gas and Electric 6,75% 15/1/2053	216.784	0,01	USD 177.000	Plains All American Pipeline / PAA Finance 4,3% 31/1/2043	131.978	0,00
USD 250.000	PacifiCorp 2,9% 15/6/2052	147.778	0,00	USD 224.000	Playtika 4,25% 15/3/2029	193.682	0,00
USD 420.000	PacifiCorp 5,35% 1/12/2053	363.218	0,01	USD 4.634.000	PNC Financial Services 3,4% 15/9/2026	3.522.089	0,07
USD 35.000	PacifiCorp 5,5% 15/5/2054	31.089	0,00	USD 209.000	Post 4,5% 15/9/2031	179.756	0,00
USD 323.000	Palomino Funding Trust I 7,233% 17/5/2028	327.156	0,01	USD 74.000	Post 4,625% 15/4/2030	65.624	0,00
				USD 114.000	Post 5,5% 15/12/2029	105.852	0,00
				USD 246.000	Post 5,625% 15/1/2028	237.396	0,01
				USD 1.027.000	PRA Health Sciences 2,875% 15/7/2026	935.026	0,02

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 392.000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5,625% 1/9/2029	306.375	0,01	USD 400.000	Regency Centers 2,95% 15/9/2029	345.458	0,01
USD 392.000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5,875% 1/9/2031	295.921	0,01	USD 825.000	Regency Centers 3,7% 15/6/2030	740.348	0,02
USD 154.000	Presidio 4,875% 1/2/2027	144.027	0,00	USD 255.000	RegionalCare Hospital Partners / LifePoint Health 9,75% 1/12/2026	237.860	0,01
USD 139.000	Prime Healthcare Services 7,25% 1/11/2025	130.387	0,00	USD 729.359	Renaissance Home Equity Loan Trust 2005-1 6,089% 25/5/2035	645.138	0,01
USD 495.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5,75% 15/4/2026	486.403	0,01	USD 1.134.563	Renaissance Home Equity Loan Trust 2005-3 5,14% 25/11/2035	1.110.530	0,02
USD 2.810.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6,25% 15/1/2028	2.687.168	0,06	USD 168.000	Republic Services 2,3% 1/3/2030	142.407	0,00
USD 112.000	Progress Energy 6% 1/12/2039	112.145	0,00	USD 124.000	Republic Services 3,95% 15/5/2028	117.685	0,00
USD 2.000.000	Progress Residential 2019-SFR4 Trust 3,435% 17/10/2036	1.913.899	0,04	USD 350.000	Republic Services 4,875% 1/4/2029	344.913	0,01
USD 12.500.000	Progress Residential 2020-SFR1 Trust 3,431% 17/4/2037	11.705.324	0,24	USD 238.000	Resideo Funding 4% 1/9/2029	199.255	0,00
USD 5.500.000	Progress Residential 2020-SFR1 Trust 4,028% 17/4/2037	5.122.246	0,11	USD 880.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,5% 15/2/2029	770.644	0,02
USD 90.000	Progressive 3% 15/3/2032	78.266	0,00	USD 1.470.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	1.364.855	0,03
USD 45.000	Progressive 3,7% 15/3/2052	34.498	0,00	USD 965.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 7,25% 15/7/2028	970.693	0,02
USD 100.000	Progressive 6,25% 1/12/2032	107.438	0,00	USD 245.000	Ritchie Bros 6,75% 15/3/2028	246.979	0,01
USD 341.000	Prologis 2,25% 15/4/2030	286.549	0,00	USD 414.000	RLJ Lodging Trust 3,75% 1/7/2026	379.700	0,01
USD 153.000	Prologis 2,25% 15/1/2032	122.882	0,00	USD 455.000	Roche 2,607% 13/12/2051	294.635	0,01
USD 43.000	Prologis 3,05% 1/3/2050	28.669	0,00	USD 1.235.000	Rockcliff Energy II 5,5% 15/10/2029	1.138.624	0,02
USD 679.000	Prologis 5,125% 15/1/2034	668.623	0,01	USD 3.705.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	3.296.524	0,07
USD 307.000	PTC 3,625% 15/2/2025	296.943	0,01	USD 120.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,875% 1/3/2031	97.341	0,00
USD 119.000	Public Service Electric and Gas 2,05% 1/8/2050	67.150	0,00	USD 155.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 4% 15/10/2033	122.576	0,00
USD 211.000	Public Service Electric and Gas 3% 1/3/2051	142.571	0,00	USD 202.000	Rockies Express Pipeline 4,95% 15/7/2029	185.291	0,00
USD 440.000	Public Service Electric and Gas 4,65% 15/3/2033	426.686	0,01	USD 215.000	RWJ Barnabas Health 3,477% 1/7/2049	160.428	0,00
USD 655.000	Public Service Electric and Gas 4,9% 15/12/2032	647.430	0,01	USD 672.000	Ryan Specialty 4,375% 1/2/2030	601.817	0,01
USD 60.000	Public Service of Colorado 3,2% 1/3/2050	40.610	0,00	USD 311.000	Ryder System 2,5% 1/9/2024	300.574	0,01
USD 180.000	Public Service of Colorado 3,8% 15/6/2047	135.816	0,00	USD 300.000	Ryder System 2,9% 1/12/2026	276.212	0,01
USD 305.000	QUALCOMM 4,3% 20/5/2047	264.586	0,01	USD 149.000	S&P Global 3,25% 1/12/2049	107.171	0,00
USD 1.446.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4,5% 15/9/2026	1.129.607	0,02	USD 135.000	Sabine Pass Liquefaction 5% 15/3/2027	132.626	0,00
USD 2.939.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6,5% 15/9/2028	1.590.323	0,03	USD 250.000	Sabine Pass Liquefaction 5,625% 1/3/2025	249.133	0,01
USD 561.000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4,875% 1/11/2026	526.427	0,01	USD 1.276.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	1.255.470	0,03
USD 4.992.901	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7,867% 25/10/2039	4.996.379	0,10	USD 86.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	84.806	0,00
USD 28.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,25% 15/4/2030	19.714	0,00	USD 213.000	Salesforce 2,7% 15/7/2041	151.994	0,00
USD 39.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,75% 15/1/2029	28.270	0,00	USD 149.000	Salesforce 2,9% 15/7/2051	100.013	0,00
USD 101.000	Realty Income 2,85% 15/12/2032	81.858	0,00	USD 139.000	Salesforce 3,05% 15/7/2061	90.261	0,00
USD 287.000	Realty Income 3% 15/1/2027	266.857	0,01	USD 163.000	San Diego Gas & Electric 2,95% 15/8/2051	106.648	0,00
USD 81.000	Realty Income 3,95% 15/8/2027	77.230	0,00	USD 380.000	San Diego Gas & Electric 4,95% 15/8/2028	376.390	0,01
USD 155.000	Realty Income 4,85% 15/3/2030	150.060	0,00	USD 463.000	San Diego Gas & Electric 5,35% 1/4/2053	449.583	0,01
USD 72.000	Realty Income 4,9% 15/7/2033	68.397	0,00	USD 1.357.000	Sasol Financing USA 8,75% 3/5/2029*	1.331.556	0,03
USD 320.000	Realty Income 5,625% 13/10/2032	319.888	0,01	USD 969.000	SBA Communications 3,125% 1/2/2029	828.994	0,02
USD 1.263.000	Regal Rexnord 6,05% 15/4/2028	1.250.313	0,03	USD 3.502.000	SBA Communications 3,875% 15/2/2027	3.242.611	0,07
USD 860.000	Regal Rexnord 6,3% 15/2/2030	856.101	0,02				
USD 671.000	Regal Rexnord 6,4% 15/4/2033	665.033	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 200.000	Science Applications International 4,875% 1/4/2028	184.331	0,00	USD 140.000	Southern California Edison 4,875% 1/3/2049	122.075	0,00
USD 134.000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6,625% 1/3/2030	118.242	0,00	USD 255.000	Southern California Edison 5,45% 1/6/2052	240.213	0,01
USD 1.102.000	SCIL IV / SCIL USA 5,375% 1/11/2026	1.038.075	0,02	USD 210.000	Southern California Edison 5,7% 1/3/2053	204.121	0,00
EUR 154.000	SCIL IV / SCIL USA 8,1% 1/11/2026	166.905	0,00	USD 260.000	Southern California Edison 5,95% 1/11/2032	269.673	0,01
EUR 429.000	SCIL IV / SCIL USA 9,5% 15/7/2028	473.729	0,01	USD 75.000	Southern Copper 5,875% 23/4/2045	73.496	0,00
USD 393.000	Scotts Miracle-Gro 4% 1/4/2031	311.331	0,01	USD 1.636.000	Southwestern Energy 5,375% 1/2/2029	1.554.635	0,03
USD 90.000	Scotts Miracle-Gro 4,375% 1/2/2032	70.750	0,00	USD 40.000	Southwestern Energy 5,7% 23/1/2025	39.613	0,00
USD 172.000	Sealed Air 5% 15/4/2029	159.481	0,00	USD 320.000	Specialty Building Products / SBP Finance 6,375% 30/9/2026	304.408	0,01
USD 646.000	Sealed Air/Sealed Air US 6,125% 1/2/2028	637.986	0,01	USD 88.000	Spectra Energy Partners 4,5% 15/3/2045	70.871	0,00
USD 100.000	Sempra 3,4% 1/2/2028	92.499	0,00	USD 284.000	Spectrum Brands 3,875% 15/3/2031	235.972	0,01
USD 415.000	Sempra 3,8% 1/2/2038	338.170	0,01	USD 367.000	Spectrum Brands 5% 1/10/2029	335.932	0,01
USD 640.000	Sempra 5,4% 1/8/2026	640.639	0,01	USD 385.000	Spectrum Brands 5,5% 15/7/2030	357.652	0,01
USD 1.636.000	Sensata Technologies 4,375% 15/2/2030	1.448.153	0,03	USD 134.000	Spirit AeroSystems 7,5% 15/4/2025	132.420	0,00
USD 2.248.000	Service International 4% 15/5/2031	1.908.035	0,04	USD 2.310.000	Spirit AeroSystems 9,375% 30/11/2029	2.406.047	0,05
USD 200.000	Service International 5,125% 1/6/2029	188.750	0,00	USD 1.045.000	Sprint Capital 6,875% 15/11/2028	1.102.475	0,02
USD 489.000	Service Properties Trust 7,5% 15/9/2025	485.544	0,01	USD 1.993.000	SRS Distribution 4,625% 1/7/2028	1.777.768	0,04
USD 230.000	Sherwin-Williams 2,3% 15/5/2030	192.229	0,00	USD 1.741.000	SRS Distribution 6% 1/12/2029	1.490.418	0,03
USD 215.000	Sherwin-Williams 3,45% 1/6/2027	202.492	0,00	USD 1.361.000	SRS Distribution 6,125% 1/7/2029	1.184.148	0,02
USD 481.000	Shift4 Payments 0% 15/12/2025	479.471	0,01	USD 2.750.000	SS&C Technologies 5,5% 30/9/2027	2.652.722	0,06
USD 1.277.000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4,625% 1/11/2026	1.195.170	0,03	USD 341.000	Stagwell Global 5,625% 15/8/2029	285.262	0,01
USD 709.000	Simmons Foods/Simmons Prepared Foods/Simmons Pet Food 4,625% 1/3/2029	589.189	0,01	EUR 329.000	Standard Industries 2,25% 21/11/2026	316.371	0,01
USD 470.000	Simon Property 5,5% 8/3/2033	462.352	0,01	USD 688.000	Standard Industries 3,375% 15/1/2031	547.176	0,01
USD 2.222.000	Sinclair Television 4,125% 1/12/2030	1.433.619	0,03	USD 1.230.000	Standard Industries 4,375% 15/7/2030	1.048.451	0,02
USD 1.934.000	Sirius XM Radio 3,125% 1/9/2026	1.737.151	0,04	USD 254.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	234.157	0,00
USD 1.964.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	1.813.577	0,04	USD 664.000	Standard Industries 5% 15/2/2027	631.696	0,01
USD 1.859.000	Six Flags Entertainment 7,25% 15/5/2031	1.787.477	0,04	USD 691.000	Staples 7,5% 15/4/2026	573.328	0,01
USD 629.000	SLM 3,125% 2/11/2026	560.408	0,01	USD 154.000	Starwood Property Trust 4,375% 15/1/2027	138.151	0,00
USD 851.000	SM Energy 5,625% 1/6/2025	838.200	0,02	USD 805.000	Starwood Property Trust 5,5% 1/11/2023	802.365	0,02
USD 265.000	SM Energy 6,5% 15/7/2028	258.613	0,01	USD 14.447.000	State Street 6,552% 15/6/2047	11.804.585	0,24
USD 89.000	SM Energy 6,625% 15/1/2027	88.343	0,00	USD 1.628.000	Station Casinos 4,5% 15/2/2028	1.456.989	0,03
USD 132.000	SM Energy 6,75% 15/9/2026	131.397	0,00	USD 940.000	Station Casinos 4,625% 1/12/2031	771.459	0,02
USD 2.486.000	Smyrna Ready Mix Concrete 6% 1/11/2028	2.386.283	0,05	USD 332.000	Steel Dynamics 1,65% 15/10/2027	284.588	0,01
USD 2.797.000	Sotheby's 7,375% 15/10/2027*	2.547.450	0,05	USD 38.000	Steel Dynamics 2,4% 15/6/2025	35.776	0,00
USD 2.021.000	Sotheby's/Bidfair 5,875% 1/6/2029	1.563.088	0,03	USD 158.000	Steel Dynamics 3,25% 15/10/2050	102.129	0,00
USD 630.000	Southern 4,475% 1/8/2024	622.644	0,01	USD 271.255	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 5,889% 25/2/2036	231.772	0,01
USD 100.000	Southern California Edison 2,95% 1/2/2051	63.624	0,00				
USD 100.000	Southern California Edison 3,45% 1/2/2052	68.571	0,00				
USD 220.000	Southern California Edison 3,65% 1/6/2051	157.384	0,00				
USD 175.000	Southern California Edison 4% 1/4/2047	135.865	0,00				
USD 225.000	Southern California Edison 4,7% 1/6/2027	221.155	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 624.248	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR4 5,809% 25/6/2036	531.353	0,01	USD 1.328.000	Tenet Healthcare 6,125% 1/10/2028	1.279.747	0,03
USD 1.636.981	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6 5,809% 25/7/2046	1.155.131	0,02	USD 290.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	281.229	0,01
USD 948.154	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2007-AR4 5,609% 25/9/2047	858.992	0,02	USD 294.000	Tenet Healthcare 6,25% 1/2/2027	290.019	0,01
USD 438.805	Structured Asset Mortgage Loan Trust 2007-MLN1 5,659% 25/1/2037	260.263	0,01	USD 4.166.000	Tenet Healthcare 6,75% 15/5/2031	4.156.526	0,09
USD 331.000	Suburban Propane Partners/ Suburban Energy Finance 5% 1/6/2031	283.431	0,01	USD 532.000	Tenneco 8% 17/11/2028	437.762	0,01
USD 43.000	Summit Materials / Summit Materials Finance 5,25% 15/1/2029	39.990	0,00	USD 1.390.000	Terex 5% 15/5/2029	1.277.514	0,03
USD 151.000	Sunoco / Sunoco Finance 5,875% 15/3/2028	146.348	0,00	USD 11.000	TerraForm Power Operating 5% 31/1/2028	10.003	0,00
USD 922.000	Surgery Center 6,75% 1/7/2025*	922.041	0,02	USD 124.000	Texas Instruments 2,7% 15/9/2051	82.234	0,00
USD 1.862.000	Surgery Center 10% 15/4/2027	1.896.354	0,04	USD 700.000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/10/2031	564.393	0,01
USD 162.000	Sutter Health 2,294% 15/8/2030	134.657	0,00	USD 185.000	Thermo Fisher Scientific 4,95% 21/11/2032	185.073	0,00
USD 143.000	Sutter Health 3,361% 15/8/2050	100.910	0,00	USD 185.000	Time Warner Cable 5,875% 15/11/2040	161.034	0,00
USD 1.349.000	SWF Escrow Issuer 6,5% 1/10/2029	870.469	0,02	USD 160.000	Titan International 7% 30/4/2028	152.507	0,00
USD 1.078.000	Synaptics 4% 15/6/2029	913.843	0,02	USD 4.910.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	4.625.875	0,10
USD 431.000	Talen Energy Supply 8,625% 1/6/2030	448.796	0,01	USD 430.000	T-Mobile USA 2,05% 15/2/2028	375.185	0,01
USD 213.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5,5% 15/1/2028	197.549	0,00	USD 785.000	T-Mobile USA 2,25% 15/2/2026	726.272	0,02
USD 174.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	166.512	0,00	USD 100.000	T-Mobile USA 2,55% 15/2/2031	82.485	0,00
USD 118.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 31/12/2030	105.834	0,00	USD 119.000	T-Mobile USA 2,7% 15/3/2032	96.922	0,00
USD 547.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/9/2031	483.411	0,01	USD 345.000	T-Mobile USA 3% 15/2/2041	243.879	0,01
USD 43.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7,5% 1/10/2025	43.106	0,00	USD 340.000	T-Mobile USA 3,3% 15/2/2051	228.651	0,01
USD 135.000	Tampa Electric 4,3% 15/6/2048	109.348	0,00	USD 600.000	T-Mobile USA 3,4% 15/10/2052	408.246	0,01
USD 175.000	Tampa Electric 4,45% 15/6/2049	144.421	0,00	USD 209.000	T-Mobile USA 3,5% 15/4/2031	182.563	0,00
USD 438.000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 4% 15/1/2032	378.303	0,01	USD 116.000	T-Mobile USA 4,5% 15/4/2050	96.233	0,00
USD 116.000	Taylor Morrison Communities 5,125% 1/8/2030	106.566	0,00	USD 380.000	Toyota Motor Credit 1,15% 13/8/2027	328.832	0,01
USD 1.513.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	1.488.111	0,03	USD 673.000	Toyota Motor Credit 3,05% 22/3/2027	631.300	0,01
USD 143.000	TEGNA 4,75% 15/3/2026	136.372	0,00	USD 60.000	Travelers 2,55% 27/4/2050	37.533	0,00
USD 1.514.000	Teleflex 4,625% 15/11/2027	1.421.376	0,03	USD 407.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	388.067	0,01
USD 810.000	Tempur Sealy International 3,875% 15/10/2031	652.164	0,01	USD 140.000	Tri Pointe Homes 5,7% 15/6/2028	132.476	0,00
USD 94.000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	81.075	0,00	USD 340.000	Trident TPI 12,75% 31/12/2028	354.107	0,01
USD 146.000	Tenet Healthcare 4,625% 15/6/2028	134.552	0,00	USD 2.665.000	Triumph 9% 15/3/2028	2.675.186	0,05
USD 1.456.000	Tenet Healthcare 4,875% 1/1/2026	1.412.546	0,03	USD 200.000	TSMC Arizona 4,5% 22/4/2052*	182.538	0,00
USD 649.000	Tenet Healthcare 5,125% 1/11/2027	618.697	0,01	USD 579.000	TTMT Escrow Issuer 8,625% 30/9/2027	597.438	0,01
				USD 38.000	TWDC Enterprises 18 4,125% 1/6/2044	32.051	0,00
				USD 522.000	Twilio 3,625% 15/3/2029	448.727	0,01
				USD 2.529.000	Twilio 3,875% 15/3/2031	2.127.159	0,04
				USD 2.108.000	Uber Technologies 0% 15/12/2025	1.973.391	0,04
				USD 2.688.000	Uber Technologies 4,5% 15/8/2029	2.467.716	0,05
				USD 1.443.000	Uber Technologies 6,25% 15/1/2028	1.430.020	0,03
				USD 1.780.000	Uber Technologies 7,5% 15/5/2025	1.797.474	0,04
				USD 1.667.000	Uber Technologies 7,5% 15/9/2027	1.699.230	0,04
				USD 557.000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	567.546	0,01
				USD 200.000	UDR 1,9% 15/3/2033	146.479	0,00
				USD 20.000	UDR 2,1% 1/8/2032	15.024	0,00
				EUR 630.000	UGI International 2,5% 1/12/2029*	534.735	0,01
				USD 100.000	Union Pacific 2,973% 16/9/2062	61.648	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 150.000	Union Pacific 3,5% 14/2/2053	111.672	0,00	USD 1.990.000	Veritas US / Veritas Bermuda 7,5% 1/9/2025	1.633.801	0,03
USD 1.000	Union Pacific 3,55% 15/8/2039	814	0,00	USD 235.000	Verizon Communications 1,5% 18/9/2030	183.620	0,00
USD 130.000	Union Pacific 3,839% 20/3/2060	100.056	0,00	USD 378.000	Verizon Communications 1,68% 30/10/2030	295.335	0,01
USD 225.000	Union Pacific 3,95% 15/8/2059	175.134	0,00	USD 207.000	Verizon Communications 2,355% 15/3/2032	163.745	0,00
USD 250.000	Union Pacific 4,05% 1/3/2046	203.842	0,00	USD 132.000	Verizon Communications 2,55% 21/3/2031	108.620	0,00
USD 125.000	Union Pacific 4,3% 1/3/2049	107.312	0,00	USD 766.000	Verizon Communications 2,65% 20/11/2040	512.342	0,01
USD 1.473.000	United Airlines 4,375% 15/4/2026	1.387.788	0,03	USD 381.000	Verizon Communications 2,85% 3/9/2041	260.355	0,01
USD 1.784.000	United Airlines 4,625% 15/4/2029	1.588.505	0,03	USD 150.000	Verizon Communications 2,987% 30/10/2056	89.781	0,00
USD 1.126.675	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027	1.125.206	0,02	USD 263.000	Verizon Communications 3,4% 22/3/2041	195.542	0,00
USD 93.743	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026	90.227	0,00	USD 503.000	Verizon Communications 3,875% 8/2/2029	469.261	0,01
USD 665.000	United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust 5,8% 15/1/2036	667.580	0,01	USD 96.000	Verizon Communications 4,016% 3/12/2029	89.106	0,00
USD 264.000	United Natural Foods 6,75% 15/10/2028	220.052	0,01	USD 191.000	Verizon Communications 4,329% 21/9/2028	182.831	0,00
USD 4.850.000	United Rentals North America 6% 15/12/2029	4.825.836	0,10	USD 58.000	Verizon Communications 4,5% 10/8/2033	53.602	0,00
USD 910.000	United States Treasury Bill 0% 14/11/2023	900.149	0,02	USD 25.000	Verizon Communications 5,05% 9/5/2033	24.244	0,00
USD 100.000	UnitedHealth 2,75% 15/5/2040	72.147	0,00	USD 230.000	Verizon Communications 5,85% 15/9/2035	230.064	0,01
USD 210.000	UnitedHealth 2,9% 15/5/2050	139.761	0,00	USD 6.511.000	Verscend Escrow 9,75% 15/8/2026	6.475.857	0,13
USD 105.000	UnitedHealth 3,25% 15/5/2051	74.726	0,00	USD 1.748.000	Vertiv 4,125% 15/11/2028	1.571.054	0,03
USD 905.000	UnitedHealth 3,5% 15/8/2039	737.968	0,02	USD 2.556.000	Viasat 5,625% 15/9/2025	2.414.040	0,05
USD 120.000	UnitedHealth 4,25% 15/6/2048	102.396	0,00	USD 280.000	Viasat 5,625% 15/4/2027	250.237	0,01
USD 380.000	UnitedHealth 4,5% 15/4/2033	366.128	0,01	USD 741.000	Viavi Solutions 3,75% 1/10/2029	617.987	0,01
USD 200.000	UnitedHealth 4,75% 15/7/2045	185.645	0,00	USD 807.000	VICI Properties 4,95% 15/2/2030	759.819	0,02
USD 340.000	UnitedHealth 5,875% 15/2/2053	363.798	0,01	USD 780.000	VICI Properties 5,125% 15/5/2032	724.616	0,02
USD 155.000	UnitedHealth 6,05% 15/2/2063	169.224	0,00	USD 828.000	VICI Properties 5,625% 15/5/2052	729.450	0,02
USD 2.598.000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	2.589.434	0,05	USD 695.000	VICI Properties / VICI Note 3,5% 15/2/2025	666.784	0,01
USD 120.000	University of Miami 4,063% 1/4/2052	98.509	0,00	USD 195.000	VICI Properties / VICI Note 3,875% 15/2/2029	171.648	0,00
USD 140.000	University of Southern California 3,841% 1/10/2047	115.562	0,00	USD 1.054.000	VICI Properties / VICI Note 4,125% 15/8/2030	923.292	0,02
USD 443.000	Univision Communications 5,125% 15/2/2025*	435.842	0,01	USD 792.000	VICI Properties / VICI Note 4,625% 1/12/2029	715.293	0,02
USD 700.000	Univision Communications 7,375% 30/6/2030*	680.376	0,01	USD 100.000	Virginia Electric and Power 2,45% 15/12/2050	57.930	0,00
USD 991.000	Univision Communications 8% 15/8/2028	992.465	0,02	USD 325.000	Virginia Electric and Power 3,8% 1/4/2028	307.284	0,01
USD 5.849.000	US Bancorp 3,7% 15/1/2027	4.401.372	0,09	USD 250.000	Virginia Electric and Power 4,45% 15/2/2044	211.835	0,00
USD 839.000	US Foods 4,625% 1/6/2030	746.164	0,02	USD 100.000	Virginia Electric and Power 8,875% 15/11/2038	129.755	0,00
USD 622.000	US Foods 4,75% 15/2/2029	567.532	0,01	USD 1.355.000	Vistra Operations 5,125% 13/5/2025	1.320.752	0,03
USD 2.065.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/4/2026	2.045.208	0,04	USD 136.000	VMware 1,8% 15/8/2028	113.787	0,00
USD 1.072.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/9/2027	1.046.296	0,02	USD 989.000	VMware 2,2% 15/8/2031	771.329	0,02
USD 352.000	Vail Resorts 6,25% 15/5/2025	351.191	0,01	USD 270.000	VMware 4,7% 15/5/2030	254.669	0,00
USD 50.000	Valero Energy 4% 1/6/2052	36.750	0,00	USD 590.000	Volkswagen of America Finance 1,25% 24/11/2025	537.671	0,01
USD 154.000	Valero Energy 4,35% 1/6/2028	147.300	0,00	USD 3.251.000	Voya Financial 6,125% 15/9/2023	3.221.513	0,07
USD 268.000	Ventas Realty 3% 15/1/2030	227.813	0,01	USD 801.000	Wabash National 4,5% 15/10/2028	679.890	0,01
USD 2.721.000	Venture Global Calcasieu Pass 3,875% 15/8/2029	2.355.952	0,05				
USD 752.000	Venture Global Calcasieu Pass 3,875% 1/11/2033	611.940	0,01				
USD 2.334.000	Venture Global Calcasieu Pass 4,125% 15/8/2031	1.982.061	0,04				
USD 4.246.000	Venture Global LNG 8,125% 1/6/2028	4.279.429	0,09				
USD 5.931.000	Venture Global LNG 8,375% 1/6/2031	5.984.468	0,12				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 110.000	Wachovia 5,5% 1/8/2035	106.277	0,00	USD 700.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5	652.990	0,01
USD 228.000	Walmart 2,65% 22/9/2051	153.936	0,00	USD 570.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45	468.593	0,01
USD 138.000	Walt Disney 3,5% 13/5/2040	110.611	0,00	USD 200.000	Welltower 3,85% 15/6/2032	175.762	0,00
USD 136.000	Walt Disney 3,6% 13/1/2051	102.532	0,00	USD 613.000	Welltower 4,125% 15/3/2029	568.891	0,01
USD 86.000	Walt Disney 6,65% 15/11/2037	96.916	0,00	USD 355.000	Welltower 4,25% 15/4/2028	335.811	0,01
USD 1.143.204	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA3 Trust 5,19% 25/4/2047	996.295	0,02	USD 1.314.000	WESCO Distribution 7,125% 15/6/2025	1.320.828	0,03
USD 932.219	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 5,18% 25/6/2047	753.296	0,02	USD 1.247.000	WESCO Distribution 7,25% 15/6/2028	1.265.875	0,03
USD 965.000	Warnermedia 5,141% 15/3/2052	770.559	0,02	USD 1.338.000	Western Midstream Operating 5,25% 1/2/2050	1.086.188	0,02
USD 750.000	Warnermedia 5,391% 15/3/2062	595.821	0,01	USD 594.000	Western Midstream Operating 5,3% 1/3/2048	487.248	0,01
USD 1.217.669	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-AR5 Trust 5,41% 25/6/2046	845.268	0,02	USD 477.000	Western Midstream Operating 5,45% 1/4/2044	400.911	0,01
USD 2.204.511	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-AR8 Trust 5,28% 25/10/2046	1.835.754	0,04	USD 379.000	Western Midstream Operating 5,5% 15/8/2048	314.403	0,01
USD 907.947	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA1 Trust 5,15% 25/12/2046	730.911	0,02	USD 645.000	Weyerhaeuser 4,75% 15/5/2026	634.620	0,01
USD 664.352	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA3 Trust 5,13% 25/4/2047	518.379	0,01	USD 5.054.000	White Cap Buyer 6,875% 15/10/2028	4.637.828	0,10
USD 1.531.443	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA5 Trust 5,27% 25/5/2047	1.305.543	0,03	USD 1.074.000	White Cap Parent 8,25% 15/3/2026	1.053.075	0,02
USD 3.144.482	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 4,162% 25/10/2036	2.329.489	0,05	USD 43.000	William Carter 5,625% 15/3/2027	41.725	0,00
USD 3.502.000	Waste Pro USA 5,5% 15/2/2026	3.304.592	0,07	USD 593.000	Williams 3,75% 15/6/2027	557.902	0,01
USD 575.000	Wells Fargo 3,526% 24/3/2028	534.799	0,01	USD 425.000	Williams 4,55% 24/6/2024	420.619	0,01
USD 205.000	Wells Fargo 3,584% 22/5/2028	190.197	0,00	USD 1.380.000	Williams 5,3% 15/8/2028	1.371.605	0,03
USD 685.000	Wells Fargo 3,908% 25/4/2026	662.092	0,01	USD 446.000	Williams Scotsman International 6,125% 15/6/2025	442.293	0,01
USD 30.000	Wells Fargo 4,4% 14/6/2046	23.751	0,00	USD 608.000	WR Grace 4,875% 15/6/2027	567.805	0,01
USD 65.000	Wells Fargo 4,65% 4/11/2044	53.980	0,00	USD 4.278.000	WR Grace 5,625% 15/8/2029	3.600.237	0,07
USD 455.000	Wells Fargo 4,75% 7/12/2046	378.644	0,01	USD 773.000	WR Grace 7,375% 1/3/2031	763.891	0,02
USD 760.000	Wells Fargo 4,808% 25/7/2028	737.035	0,02	USD 486.000	WRKCo 3% 15/6/2033	393.776	0,01
USD 1.232.000	Wells Fargo 4,897% 25/7/2033	1.162.052	0,02	USD 383.000	WRKCo 3,75% 15/3/2025	371.460	0,01
USD 590.000	Wells Fargo 5,013% 4/4/2051	533.243	0,01	USD 89.000	WRKCo 3,9% 1/6/2028	82.536	0,00
USD 623.000	Wells Fargo 5,389% 24/4/2034	607.134	0,01	USD 150.000	WRKCo 4,9% 15/3/2029	144.231	0,00
USD 954.000	Wells Fargo 5,557% 25/7/2034	942.287	0,02	USD 371.000	Wyndham Hotels & Resorts 4,375% 15/8/2028	339.682	0,01
USD 960.000	Wells Fargo 5,574% 25/7/2029	955.396	0,02	USD 1.015.000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5,25% 15/5/2027	960.483	0,02
USD 400.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS3 4,646% 15/9/2057	371.523	0,01	USD 2.455.000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5,125% 1/10/2029	2.200.280	0,05
USD 2.946.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 1,389% 15/8/2049	88.879	0,00	USD 678.000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7,125% 15/2/2031	665.986	0,01
USD 701.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 4,635% 15/12/2049	588.841	0,01	USD 319.000	XPO Escrow Sub 7,5% 15/11/2027	324.688	0,01
USD 4.647.953	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC25 0,969% 15/12/2059	100.130	0,00	USD 11.435.000	Zayo 4% 1/3/2027	8.599.206	0,18
USD 2.080.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC25 4,481% 15/12/2059	1.767.019	0,04	USD 1.882.000	Zayo 6,125% 1/3/2028	1.224.302	0,03
				USD 2.481.000	ZoomInfo Technologies/ ZoomInfo Finance 3,875% 1/2/2029*	2.111.260	0,04
						1.278.739.736	26,40
					Uruguay		
				USD 452.717	Uruguay Government International Bond 4,375% 27/10/2027	451.746	0,01
				USD 720.000	Uruguay Government International Bond 5,75% 28/10/2034	773.464	0,02
						1.225.210	0,03
				Total des obligations		2.588.251.037	53,47

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
OBLIGATIONS INDEXÉES SUR DES ACTIONS				USD 18.860	Royal Bank of Canada (Fund receives 12,75% Fixed; and receives/pays return on American Electric Power) (18/9/2023)	1.508.493	0,03
USD 39.200	BNP Paribas (Fund receives 16,6% Fixed; and receives/pays return on Cisco Systems) (12/10/2023)	2.121.825	0,04	USD 13.326	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,05% Fixed; and receives/pays return on Hilton Worldwide) (15/9/2023)	2.007.199	0,04
USD 15.000	BNP Paribas (Fund receives 16,72% Fixed; and receives/pays return on American Electric Power) (12/10/2023)	1.208.657	0,03	USD 2.741	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,1% Fixed; and receives/pays return on Everest) (28/9/2023)	990.562	0,02
USD 17.600	BNP Paribas (Fund receives 30,85% Fixed; and receives/pays return on Intel) (12/10/2023)	605.084	0,01	USD 44.153	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,19% Fixed; and receives/pays return on Flex) (18/9/2023)	1.224.339	0,03
USD 41.900	Bank of Montreal (Fund receives 14,32% Fixed; and receives/pays return on American International) (30/10/2023)	2.445.284	0,05	USD 5.349	Royal Bank of Canada (Fund receives 13,61% Fixed; and receives/pays return on Servicenow) (18/9/2023)	3.138.726	0,07
USD 6.300	Bank of Montreal (Fund receives 16,67% Fixed; and receives/pays return on MSC Industrial Direct) (19/10/2023)	638.211	0,01	USD 61.784	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,17% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (15/9/2023)	8.308.948	0,17
USD 22.000	Bank of Montreal (Fund receives 17,18% Fixed; and receives/pays return on Cardinal Health) (19/10/2023)	1.959.073	0,04	USD 625	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,39% Fixed; and receives/pays return on Booking) (27/9/2023)	1.949.000	0,04
USD 11.700	Bank of Montreal (Fund receives 19,451% Fixed; and receives/pays return on Laboratory Corporation of America) (14/9/2023)	2.836.486	0,06	USD 13.750	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,52% Fixed; and receives/pays return on Ebay) (18/9/2023)	614.905	0,01
USD 7.600	Bank of Montreal (Fund receives 22,245% Fixed; and receives/pays return on Cigna) (14/9/2023)	2.102.161	0,04	USD 65.300	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,71% Fixed; and receives/pays return on Fidelity National Financial) (30/10/2023)	2.668.596	0,06
USD 21.000	Bank of Montreal (Fund receives 24,716% Fixed; and receives/pays return on HP) (14/9/2023)	610.529	0,01	USD 10.802	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,92% Fixed; and receives/pays return on Hess) (15/9/2023)	1.658.278	0,03
USD 132.200	Bank of Montreal (Fund receives 24,85% Fixed; and receives/pays return on Nokia) (19/10/2023)	521.362	0,01	USD 3.293	Royal Bank of Canada (Fund receives 14,95% Fixed; and receives/pays return on Parker-Hannifin) (26/9/2023)	1.388.499	0,03
USD 63.300	Bank of Montreal (Fund receives 33,46% Fixed; and receives/pays return on Newell Brands) (19/10/2023)	671.539	0,01	USD 8.224	Royal Bank of Canada (Fund receives 15,51% Fixed; and receives/pays return on Cigna) (26/9/2023)	2.325.160	0,05
USD 134.948	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,12% Fixed; and receives/pays return on AT&T) (15/9/2023)	2.002.140	0,04	USD 56.300	Royal Bank of Canada (Fund receives 15,6% Fixed; and receives/pays return on PG&E) (28/9/2023)	940.794	0,02
USD 5.268	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,37% Fixed; and receives/pays return on Thermo Fisher Scientific) (15/9/2023)	2.972.629	0,06	USD 10.700	Royal Bank of Canada (Fund receives 16,05% Fixed; and receives/pays return on Public Service Enterprise) (2/10/2023)	656.474	0,01
USD 11.100	Royal Bank of Canada (Fund receives 10,77% Fixed; and receives/pays return on Semptra) (30/10/2023)	795.981	0,02	USD 17.117	Royal Bank of Canada (Fund receives 16,31% Fixed; and receives/pays return on ConocoPhillips) (26/9/2023)	2.026.608	0,04
EUR 25.587	Royal Bank of Canada (Fund receives 11,23% Fixed; and receives/pays return on Publicis Groupe) (14/9/2023)	2.010.505	0,04	USD 25.790	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,03% Fixed; and receives/pays return on Walt Disney) (28/9/2023)	2.203.231	0,05
USD 28.843	Royal Bank of Canada (Fund receives 11,55% Fixed; and receives/pays return on Starbucks) (25/9/2023)	2.876.799	0,06	EUR 74.537	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,38% Fixed; and receives/pays return on Koninklijke Philips) (14/9/2023)	1.636.324	0,03

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 27.814	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,55% Fixed; and receives/pays return on Borgwarner) (25/9/2023)	1.148.751	0,02	USD 5.924	Royal Bank of Canada (Fund receives 8,87% Fixed; and receives/pays return on Becton Dickinson) (26/9/2023)	1.638.464	0,03
USD 15.952	Royal Bank of Canada (Fund receives 17,6% Fixed; and receives/pays return on Meta Platforms) (18/9/2023)	4.801.886	0,10	USD 22.026	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,03% Fixed; and receives/pays return on Otis Worldwide) (15/9/2023)	1.913.132	0,04
USD 27.042	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,2% Fixed; and receives/pays return on Fidelity National Information Services) (25/9/2023)	1.529.042	0,03	USD 5.501	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,31% Fixed; and receives/pays return on McKesson) (26/9/2023)	2.318.922	0,05
USD 10.182	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,2% Fixed; and receives/pays return on LyondellBasell Industries) (27/9/2023)	1.007.982	0,02	USD 9.490	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,48% Fixed; and receives/pays return on Automatic Data Processing) (15/9/2023)	2.425.014	0,05
USD 15.971	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,39% Fixed; and receives/pays return on Valero Energy) (18/9/2023)	2.067.937	0,04	USD 4.136	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,49% Fixed; and receives/pays return on Humana) (25/9/2023)	1.960.509	0,04
USD 2.243	Royal Bank of Canada (Fund receives 18,89% Fixed; and receives/pays return on United Rentals) (18/9/2023)	1.049.594	0,02	USD 52.981	Royal Bank of Canada (Fund receives 9,71% Fixed; and receives/pays return on Apple) (27/9/2023)	9.966.884	0,21
USD 34.100	Royal Bank of Canada (Fund receives 19,19% Fixed; and receives/pays return on Exelon) (14/9/2023)	1.374.574	0,03	USD 68.507	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,15% Fixed; and receives/pays return on Wells Fargo) (16/10/2023)	2.877.294	0,06
USD 11.266	Royal Bank of Canada (Fund receives 20,12% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	1.564.925	0,03	USD 32.508	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,4% Fixed; and receives/pays return on JPMorgan Chase) (16/10/2023)	4.835.890	0,10
USD 175.900	Royal Bank of Canada (Fund receives 20,6% Fixed; and receives/pays return on Kosmos Energy) (30/10/2023)	1.291.722	0,03	USD 106.448	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,57% Fixed; and receives/pays return on BP) (29/9/2023)	3.965.317	0,08
USD 71.900	Royal Bank of Canada (Fund receives 21,44% Fixed; and receives/pays return on Baxter International) (19/10/2023)	3.048.690	0,06	USD 23.164	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,6% Fixed; and receives/pays return on Paccar) (14/9/2023)	1.925.386	0,04
GBP 9.700	Royal Bank of Canada (Fund receives 21,89% Fixed; and receives/pays return on Astrazeneca) (21/9/2023)	1.279.350	0,03	USD 41.486	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 10,8% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (27/10/2023)	1.940.715	0,04
USD 3.900	Royal Bank of Canada (Fund receives 25,46% Fixed; and receives/pays return on Ralph Lauren) (19/10/2023)	463.749	0,01	USD 6.126	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 11,37% Fixed; and receives/pays return on Vulcan Materials) (26/9/2023)	1.341.206	0,03
USD 44.400	Royal Bank of Canada (Fund receives 26,04% Fixed; and receives/pays return on Equitable) (19/10/2023)	1.284.794	0,03	USD 15.644	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 12,02% Fixed; and receives/pays return on Johnson Controls International) (25/9/2023)	931.865	0,02
EUR 41.800	Royal Bank of Canada (Fund receives 26,81% Fixed; and receives/pays return on Koninklijke Philips) (5/10/2023)	896.352	0,02	USD 24.706	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 13,62% Fixed; and receives/pays return on Gilead Sciences) (27/9/2023)	1.889.295	0,04
EUR 32.418	Royal Bank of Canada (Fund receives 5,87% Fixed; and receives/pays return on Danone) (20/9/2023)	1.913.846	0,04	USD 14.855	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 14,52% Fixed; and receives/pays return on Dow) (14/9/2023)	814.012	0,02
USD 23.000	Royal Bank of Canada (Fund receives 6,77% Fixed; and receives/pays return on Unilever) (30/10/2023)	1.180.130	0,03	USD 7.937	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 16% Fixed; and receives/pays return on Marathon Petroleum) (29/9/2023)	1.130.707	0,02
USD 18.814	Royal Bank of Canada (Fund receives 7,29% Fixed; and receives/pays return on Fiserv) (15/9/2023)	2.307.270	0,05				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 60.800	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 19,41% Fixed; and receives/pays return on Sealed Air) (8/9/2023)	2.267.440	0,05	USD 18.700	Societe Generale (Fund receives 0,4643% Fixed; and receives/pays return on Zimmer Biomet) (2/10/2023)	2.264.526	0,05
USD 900	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 19,51% Fixed; and receives/pays return on Humana) (14/9/2023)	399.922	0,01	USD 28.600	Societe Generale (Fund receives 0,526% Fixed; and receives/pays return on Leidos) (2/11/2023)	2.774.944	0,06
USD 52.800	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 21,11% Fixed; and receives/pays return on Cognizant Technology Solutions) (12/10/2023)	3.590.728	0,08	USD 27.906	Societe Generale (Fund receives 0,55% Fixed; and receives/pays return on Kraft Heinz) (25/9/2023)	932.766	0,02
USD 12.300	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 23,2% Fixed; and receives/pays return on Lear) (12/10/2023)	1.812.429	0,04	USD 8.524	Societe Generale (Fund receives 0,6017% Fixed; and receives/pays return on Elevance Health) (11/9/2023)	3.895.471	0,08
USD 53.400	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 26,46% Fixed; and receives/pays return on Carlyle) (19/10/2023)	1.782.111	0,04	USD 44.415	Societe Generale (Fund receives 0,6387% Fixed; and receives/pays return on Synchrony Financial) (11/9/2023)	1.448.773	0,03
USD 12.078	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 6,7% Fixed; and receives/pays return on Waste Management) (15/9/2023)	1.905.912	0,04	USD 3.400	Societe Generale (Fund receives 0,6723% Fixed; and receives/pays return on Elevance Health) (2/10/2023)	1.560.143	0,03
USD 20.220	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 6,73% Fixed; and receives/pays return on AbbVie) (18/9/2023)	3.009.876	0,06	USD 32.600	Societe Generale (Fund receives 0,683% Fixed; and receives/pays return on Fox) (2/11/2023)	1.089.895	0,02
USD 31.199	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,36% Fixed; and receives/pays return on Nasdaq) (11/9/2023)	1.642.411	0,03	USD 37.200	Societe Generale (Fund receives 0,7233% Fixed; and receives/pays return on Fidelity National Information Services) (2/11/2023)	2.090.229	0,04
USD 66.432	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,51% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (18/9/2023)	3.100.703	0,06	USD 3.800	Societe Generale (Fund receives 0,794% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (2/11/2023)	510.416	0,01
USD 8.714	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 8,52% Fixed; and receives/pays return on YUM! Brands) (25/9/2023)	1.140.804	0,02	USD 8.456	Societe Generale (Fund receives 0,8533% Fixed; and receives/pays return on Arista Networks) (21/9/2023)	1.628.819	0,04
USD 818	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,7% Fixed; and receives/pays return on Autozone) (19/9/2023)	2.066.640	0,04	USD 1.500	Societe Generale (Fund receives 0,9042% Fixed; and receives/pays return on Meta Platforms) (2/11/2023)	444.860	0,01
USD 7.298	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,97% Fixed; and receives/pays return on HCA Healthcare) (18/9/2023)	2.040.879	0,04	USD 53.837	Societe Generale (Fund receives 0,9047% Fixed; and receives/pays return on Ally Financial) (11/9/2023)	1.499.101	0,03
USD 4.748	Mizuho Markets Cayman LP (Fund receives 9,98% Fixed; and receives/pays return on Costco Wholesale) (22/9/2023)	2.509.904	0,05	USD 49.322	Societe Generale (Fund receives 0,9963% Fixed; and receives/pays return on Mosaic) (25/9/2023)	1.948.116	0,04
USD 14.387	BNP Paribas (Fund receives 14,45% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/10/2023)	1.940.950	0,04	USD 19.430	Societe Generale (Fund receives 1,062% Fixed; and receives/pays return on Citizens Financial) (11/9/2023)	551.007	0,01
USD 10.662	Societe Generale (Fund receives 0,2437% Fixed; and receives/pays return on Zimmer Biomet) (21/9/2023)	1.288.794	0,03	USD 25.572	BNP Paribas (Fund receives 10,76% Fixed; and receives/pays return on UnitedHealth) (16/10/2023)	12.602.649	0,26
USD 8.419	Societe Generale (Fund receives 0,382% Fixed; and receives/pays return on AmerisourceBergen) (25/9/2023)	1.505.742	0,03	USD 46.362	BNP Paribas (Fund receives 11,3% Fixed; and receives/pays return on Citigroup) (16/10/2023)	1.934.223	0,04
USD 5.493	Societe Generale (Fund receives 0,3827% Fixed; and receives/pays return on Ecolab) (21/9/2023)	1.014.655	0,02	USD 7.815	BNP Paribas (Fund receives 11,98% Fixed; and receives/pays return on Marriott International) (21/9/2023)	1.607.341	0,03

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 20.863	BNP Paribas (Fund receives 12,46% Fixed; and receives/pays return on Kellogg) (26/9/2023)	1.283.526	0,03	GBP 90.000	BNP Paribas (Fund receives 23,72% Fixed; and receives/pays return on Shell) (21/9/2023)	2.687.216	0,06
USD 15.870	BNP Paribas (Fund receives 12,81% Fixed; and receives/pays return on Occidental Petroleum) (26/9/2023)	992.856	0,02	USD 15.659	BNP Paribas (Fund receives 27,09% Fixed; and receives/pays return on Comerica) (13/9/2023)	752.158	0,02
USD 1.288	BNP Paribas (Fund receives 13,12% Fixed; and receives/pays return on Equinix) (26/9/2023)	1.005.297	0,02	USD 10.147	BNP Paribas (Fund receives 6,2% Fixed; and receives/pays return on McDonald's) (18/9/2023)	2.878.174	0,06
EUR 27.180	BNP Paribas (Fund receives 13,31% Fixed; and receives/pays return on Randstad) (20/9/2023)	1.598.479	0,03	USD 6.880	BNP Paribas (Fund receives 8,1% Fixed; and receives/pays return on Stryker) (27/9/2023)	1.985.536	0,04
USD 121.030	BNP Paribas (Fund receives 13,67% Fixed; and receives/pays return on Ford Motor) (19/9/2023)	1.476.834	0,03	USD 39.303	BNP Paribas (Fund receives 8,37% Fixed; and receives/pays return on CVS Health) (25/9/2023)	2.623.510	0,05
USD 13.631	BNP Paribas (Fund receives 14,07% Fixed; and receives/pays return on Voya Financial) (28/9/2023)	973.101	0,02	USD 312	BNP Paribas (Fund receives 9,26% Fixed; and receives/pays return on Chipotle Mexican Grill) (18/9/2023)	603.572	0,01
USD 21.991	BNP Paribas (Fund receives 15,04% Fixed; and receives/pays return on MGM Resorts International) (26/9/2023)	974.516	0,02	USD 10.494	BNP Paribas (Fund receives 9,95% Fixed; and receives/pays return on Zoetis) (27/9/2023)	2.007.683	0,04
USD 14.932	BNP Paribas (Fund receives 15,22% Fixed; and receives/pays return on Molson Coors Beverage) (21/9/2023)	949.222	0,02	EUR 14.830	BNP Paribas (Fund receives 9,98% Fixed; and receives/pays return on Essilorluxottica) (20/9/2023)	2.841.886	0,06
USD 27.543	BNP Paribas (Fund receives 15,34% Fixed; and receives/pays return on Delta Air Lines) (13/10/2023)	1.170.419	0,02	USD 14.255	JP Morgan (Fund receives 13,92% Fixed; and receives/pays return on NextEra Energy) (27/10/2023)	969.583	0,02
USD 24.763	BNP Paribas (Fund receives 15,35% Fixed; and receives/pays return on Best Buy) (22/11/2023)	1.905.018	0,04	USD 36.241	JP Morgan (Fund receives 15,96% Fixed; and receives/pays return on Bank of America) (1/9/2023)	1.052.283	0,02
USD 6.065	BNP Paribas (Fund receives 16,01% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (27/9/2023)	1.988.863	0,04	USD 13.893	JP Morgan (Fund receives 16,57% Fixed; and receives/pays return on Las Vegas Sands) (12/9/2023)	772.913	0,02
EUR 9.300	BNP Paribas (Fund receives 16,38% Fixed; and receives/pays return on Danone) (21/9/2023)	548.714	0,01	USD 6.500	JP Morgan (Fund receives 16,72% Fixed; and receives/pays return on Willis Towers Watson) (28/9/2023)	1.377.410	0,03
USD 3.364	BNP Paribas (Fund receives 16,89% Fixed; and receives/pays return on Palo Alto Networks) (17/11/2023)	792.588	0,02	USD 3.900	JP Morgan (Fund receives 17,15% Fixed; and receives/pays return on Robert Half International) (28/9/2023)	297.783	0,01
USD 20.567	BNP Paribas (Fund receives 18,83% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/9/2023)	2.846.655	0,06	USD 2.013	JP Morgan (Fund receives 17,49% Fixed; and receives/pays return on ServiceNow) (1/9/2023)	1.098.381	0,02
EUR 11.400	BNP Paribas (Fund receives 20,16% Fixed; and receives/pays return on Airbus) (21/9/2023)	1.621.995	0,03	USD 23.206	JP Morgan (Fund receives 17,51% Fixed; and receives/pays return on Fortinet) (2/11/2023)	1.391.266	0,03
USD 1.600	BNP Paribas (Fund receives 20,26% Fixed; and receives/pays return on First Citizens BancShares) (26/10/2023)	2.208.961	0,05	USD 10.124	JP Morgan (Fund receives 17,52% Fixed; and receives/pays return on Phillips 66) (29/9/2023)	1.159.184	0,02
USD 18.816	BNP Paribas (Fund receives 21,12% Fixed; and receives/pays return on Voya Financial) (28/9/2023)	1.888.967	0,04	USD 13.000	JP Morgan (Fund receives 17,9% Fixed; and receives/pays return on Sony) (8/9/2023)	1.085.457	0,02
EUR 3.700	BNP Paribas (Fund receives 22,91% Fixed; and receives/pays return on Siemens) (21/9/2023)	563.906	0,01	USD 45.609	JP Morgan (Fund receives 18,24% Fixed; and receives/pays return on American Airlines) (12/9/2023)	677.641	0,01

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.400	JP Morgan (Fund receives 18,49% Fixed; and receives/pays return on Eli Lilly) (26/10/2023)	768.038	0,02	USD 15.922	Barclays (Fund receives 11,43% Fixed; and receives/pays return on Agilent Technologies) (29/9/2023)	1.950.239	0,04
USD 14.081	JP Morgan (Fund receives 18,51% Fixed; and receives/pays return on United Airlines) (12/9/2023)	707.444	0,02	USD 4.100	Barclays (Fund receives 11,83% Fixed; and receives/pays return on Visa) (28/9/2023)	1.005.676	0,02
USD 4.600	JP Morgan (Fund receives 19,12% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (26/10/2023)	1.509.742	0,03	USD 9.152	Barclays (Fund receives 12,28% Fixed; and receives/pays return on DTE Energy) (27/10/2023)	958.444	0,02
USD 49.400	JP Morgan (Fund receives 19,93% Fixed; and receives/pays return on Comcast) (26/10/2023)	2.332.744	0,05	USD 13.502	Barclays (Fund receives 15,09% Fixed; and receives/pays return on Sempra) (3/11/2023)	966.920	0,02
USD 56.400	JP Morgan (Fund receives 21,12% Fixed; and receives/pays return on Citigroup) (26/10/2023)	2.380.145	0,05	USD 45.601	Barclays (Fund receives 16,67% Fixed; and receives/pays return on Baker Hughes) (11/9/2023)	1.643.924	0,03
USD 7.600	JP Morgan (Fund receives 21,33% Fixed; and receives/pays return on ConocoPhillips) (26/10/2023)	895.541	0,02	USD 14.307	Barclays (Fund receives 18,02% Fixed; and receives/pays return on Schlumberger) (13/9/2023)	831.048	0,02
USD 6.666	JP Morgan (Fund receives 21,77% Fixed; and receives/pays return on Meta Platforms) (26/10/2023)	1.962.945	0,04	USD 5.097	Barclays (Fund receives 18,9% Fixed; and receives/pays return on Automation) (13/9/2023)	808.653	0,02
USD 33.700	JP Morgan (Fund receives 22,47% Fixed; and receives/pays return on Medtronic) (2/10/2023)	2.789.925	0,06	GBP 131.800	Barclays (Fund receives 19,38% Fixed; and receives/pays return on BAE Systems) (21/9/2023)	1.521.481	0,03
USD 21.751	JP Morgan (Fund receives 5,29% Fixed; and receives/pays return on TJX) (29/9/2023)	1.997.154	0,04	EUR 32.000	Barclays (Fund receives 20,9% Fixed; and receives/pays return on Bayer) (5/10/2023)	1.777.409	0,04
USD 8.599	JP Morgan (Fund receives 6,14% Fixed; and receives/pays return on Walmart) (17/11/2023)	1.367.224	0,03	USD 13.000	Barclays (Fund receives 21,56% Fixed; and receives/pays return on Dollar General) (30/10/2023)	2.014.870	0,04
USD 8.508	JP Morgan (Fund receives 6,93% Fixed; and receives/pays return on Marsh & McLennan) (12/9/2023)	1.660.146	0,03	GBP 73.400	Barclays (Fund receives 22,6% Fixed; and receives/pays return on British American Tobacco) (5/10/2023)	2.434.367	0,05
USD 14.115	JP Morgan (Fund receives 7,33% Fixed; and receives/pays return on T-Mobile US) (19/9/2023)	1.944.275	0,04	GBP 1.632.500	Barclays (Fund receives 25% Fixed; and receives/pays return on Vodafone) (5/10/2023)	1.527.658	0,03
EUR 30.268	JP Morgan (Fund receives 7,92% Fixed; and receives/pays return on SAP) (14/9/2023)	4.094.343	0,08	GBP 110.800	Barclays (Fund receives 26,55% Fixed; and receives/pays return on Prudential) (21/9/2023)	1.382.480	0,03
USD 9.260	JP Morgan (Fund receives 9,93% Fixed; and receives/pays return on Travelers) (12/9/2023)	1.492.669	0,03	USD 70.485	Barclays (Fund receives 5,39% Fixed; and receives/pays return on Cisco Systems) (2/10/2023)	4.004.642	0,08
USD 38.900	UBS (Fund receives 19,9% Fixed; and receives/pays return on General Motors) (2/10/2023)	1.326.028	0,03	USD 12.145	Barclays (Fund receives 6,83% Fixed; and receives/pays return on Philip Morris International) (12/9/2023)	1.182.101	0,02
USD 52.000	UBS (Fund receives 23,3% Fixed; and receives/pays return on AT&T) (14/9/2023)	769.044	0,02	USD 9.995	Goldman Sachs (Fund receives 10,35% Fixed; and receives/pays return on Starbucks) (2/11/2023)	977.775	0,02
USD 30.994	UBS (Fund receives 6,3% Fixed; and receives/pays return on Walmart) (2/10/2023)	4.978.866	0,10	USD 37.655	Goldman Sachs (Fund receives 11,79% Fixed; and receives/pays return on Target) (29/9/2023)	4.774.656	0,10
GBP 92.383	Barclays (Fund receives 10,42% Fixed; and receives/pays return on Unilever) (20/9/2023)	4.793.931	0,10	USD 14.295	Goldman Sachs (Fund receives 16,03% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (27/10/2023)	1.956.931	0,04

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.335	Goldman Sachs (Fund receives 20,75% Fixed; and receives/pays return on Netflix) (18/10/2023)	984.586	0,02	USD 3.859	Citigroup (Fund receives 10,6% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (1/9/2023)	1.268.613	0,03
USD 2.241	Goldman Sachs (Fund receives 21,49% Fixed; and receives/pays return on Netflix) (27/9/2023)	979.023	0,02	USD 7.028	Citigroup (Fund receives 10,74% Fixed; and receives/pays return on Apple) (1/9/2023)	1.288.861	0,03
USD 4.506	Goldman Sachs (Fund receives 9,61% Fixed; and receives/pays return on Synopsys) (2/10/2023)	2.032.300	0,04	USD 30.878	Citigroup (Fund receives 10,76% Fixed; and receives/pays return on CSX) (13/9/2023)	942.374	0,02
EUR 20.900	HSBC (Fund receives 16% Fixed; and receives/pays return on Sanofi) (5/10/2023)	2.222.931	0,05	USD 1.431	Citigroup (Fund receives 11,34% Fixed; and receives/pays return on O'Reilly Automotive) (26/10/2023)	1.348.231	0,03
GBP 8.200	HSBC (Fund receives 19,77% Fixed; and receives/pays return on Reckitt Benckiser) (21/9/2023)	599.328	0,01	USD 2.144	Citigroup (Fund receives 11,42% Fixed; and receives/pays return on UnitedHealth) (1/9/2023)	1.053.684	0,02
GBP 514.800	HSBC (Fund receives 24,04% Fixed; and receives/pays return on BP) (21/9/2023)	3.068.380	0,06	USD 13.971	Citigroup (Fund receives 11,85% Fixed; and receives/pays return on Caterpillar) (21/9/2023)	3.968.029	0,08
USD 23.275	Nomura (Fund receives 11,1% Fixed; and receives/pays return on Archer-Daniels-Midland) (14/9/2023)	1.868.764	0,04	USD 83.864	Citigroup (Fund receives 12,05% Fixed; and receives/pays return on Pfizer) (21/9/2023)	3.015.304	0,06
USD 58.572	Nomura (Fund receives 11,22% Fixed; and receives/pays return on Verizon Communications) (14/9/2023)	2.032.255	0,04	USD 5.497	Citigroup (Fund receives 12,65% Fixed; and receives/pays return on Eaton) (21/9/2023)	1.239.214	0,03
USD 32.554	Nomura (Fund receives 14,18% Fixed; and receives/pays return on Morgan Stanley) (8/9/2023)	2.778.390	0,06	USD 19.844	Citigroup (Fund receives 12,98% Fixed; and receives/pays return on BJ's Wholesale Club) (17/11/2023)	1.334.771	0,03
USD 30.352	Nomura (Fund receives 14,81% Fixed; and receives/pays return on Charles Schwab) (8/9/2023)	1.812.683	0,04	USD 7.364	Citigroup (Fund receives 13,09% Fixed; and receives/pays return on JP Morgan Chase) (1/9/2023)	1.075.122	0,02
USD 26.636	Nomura (Fund receives 15,64% Fixed; and receives/pays return on NextEra Energy) (14/9/2023)	1.798.531	0,04	USD 4.512	Citigroup (Fund receives 13,24% Fixed; and receives/pays return on Danaher) (1/9/2023)	1.071.470	0,02
USD 23.600	Nomura (Fund receives 18,64% Fixed; and receives/pays return on Williams) (14/9/2023)	799.825	0,02	USD 17.184	Citigroup (Fund receives 13,25% Fixed; and receives/pays return on Toll Brothers) (27/10/2023)	1.386.575	0,03
USD 79.500	Nomura (Fund receives 18,75% Fixed; and receives/pays return on Kraft Heinz) (28/9/2023)	2.652.236	0,05	USD 17.525	Citigroup (Fund receives 13,38% Fixed; and receives/pays return on Bank of New York Mellon) (8/9/2023)	785.959	0,02
USD 47.300	Nomura (Fund receives 20,86% Fixed; and receives/pays return on SS&C Technologies) (2/11/2023)	2.688.714	0,06	USD 9.083	Citigroup (Fund receives 13,49% Fixed; and receives/pays return on PNC Financial Services) (8/9/2023)	1.108.879	0,02
USD 2.800	Nomura (Fund receives 24,56% Fixed; and receives/pays return on Novo Nordisk) (14/9/2023)	438.173	0,01	USD 48.053	Citigroup (Fund receives 13,54% Fixed; and receives/pays return on Exxon Mobil) (19/9/2023)	5.234.992	0,11
USD 63.254	Nomura (Fund receives 8,64% Fixed; and receives/pays return on Shell) (29/9/2023)	3.935.595	0,08	USD 18.858	Citigroup (Fund receives 13,98% Fixed; and receives/pays return on Chevron) (19/9/2023)	3.042.832	0,06
USD 15.051	Citigroup (Fund receives 10,23% Fixed; and receives/pays return on Kimberly-Clark) (14/9/2023)	1.942.087	0,04	USD 36.876	Citigroup (Fund receives 14,15% Fixed; and receives/pays return on Flex) (26/10/2023)	997.536	0,02
USD 5.336	Citigroup (Fund receives 10,46% Fixed; and receives/pays return on PPG Industries) (13/9/2023)	764.144	0,02	USD 37.869	Citigroup (Fund receives 14,25% Fixed; and receives/pays return on Merck & Co) (21/9/2023)	4.118.611	0,08

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 11.913	Citigroup (Fund receives 14,35% Fixed; and receives/pays return on Microsoft) (15/9/2023)	3.941.591	0,08	USD 4.486	Citigroup (Fund receives 25,99% Fixed; and receives/pays return on Avis Budget) (21/9/2023)	981.061	0,02
USD 161.888	Citigroup (Fund receives 14,51% Fixed; and receives/pays return on Bank of America) (8/9/2023)	4.693.342	0,10	USD 14.357	Citigroup (Fund receives 5% Fixed; and receives/pays return on Abbott Laboratories) (12/9/2023)	1.500.619	0,03
USD 37.133	Citigroup (Fund receives 15,38% Fixed; and receives/pays return on General Motors) (14/9/2023)	1.252.393	0,03	USD 3.486	Citigroup (Fund receives 6,82% Fixed; and receives/pays return on McDonald's) (1/9/2023)	990.714	0,02
USD 4.607	Citigroup (Fund receives 15,67% Fixed; and receives/pays return on Nucor) (14/9/2023)	792.814	0,02	USD 15.920	Citigroup (Fund receives 8,16% Fixed; and receives/pays return on Sysco) (21/9/2023)	1.123.525	0,02
USD 10.011	Citigroup (Fund receives 16,42% Fixed; and receives/pays return on Alphabet) (1/9/2023)	1.289.916	0,03	USD 7.728	Citigroup (Fund receives 8,57% Fixed; and receives/pays return on Danaher) (14/9/2023)	2.049.424	0,04
USD 10.477	Citigroup (Fund receives 16,77% Fixed; and receives/pays return on Amazon.com) (1/9/2023)	1.317.811	0,03	USD 4.118	Citigroup (Fund receives 9,82% Fixed; and receives/pays return on Gartner) (21/9/2023)	1.442.890	0,03
USD 28.183	Citigroup (Fund receives 17,17% Fixed; and receives/pays return on Fifth Third Bancorp) (13/9/2023)	755.019	0,01	Total des obligations indexées sur des actions		425.103.484	8,78
USD 71.700	Citigroup (Fund receives 19,44% Fixed; and receives/pays return on Wells Fargo) (8/9/2023)	2.987.785	0,06	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		4.679.963.454	96,69
USD 4.989	Citigroup (Fund receives 20,27% Fixed; and receives/pays return on Meta Platforms) (1/9/2023)	1.311.428	0,03	Autres titres négociables			
USD 61.900	Citigroup (Fund receives 20,77% Fixed; and receives/pays return on Verizon Communications) (8/9/2023)	2.165.677	0,04	ACTIONS ORDINAIRES			
USD 10.500	Citigroup (Fund receives 21,06% Fixed; and receives/pays return on Raymond James Financial) (8/9/2023)	1.077.230	0,02	Chypre			
USD 23.782	Citigroup (Fund receives 21,35% Fixed; and receives/pays return on Freeport-McMoRan) (12/9/2023)	964.503	0,02	385.423	Fix Price**	674.490	0,01
USD 52.954	Citigroup (Fund receives 22,08% Fixed; and receives/pays return on The AES) (3/11/2023)	964.292	0,02	23.248	TCS**	371.968	0,01
USD 42.300	Citigroup (Fund receives 23,43% Fixed; and receives/pays return on Citizens Financial) (8/9/2023)	1.186.436	0,02				
USD 45.936	Citigroup (Fund receives 24,71% Fixed; and receives/pays return on First Horizon) (11/9/2023)	582.195	0,01				
				Luxembourg			
				14.280	ADLER**	7.746	0,00
				Fédération de Russie			
				387.085	Alrosa**	40	0,00
				157.961	LUKOIL**	17	0,00
				1	Mobile TeleSystems**	–	0,00
				270	Novatek**	–	0,00
				7	Novolipetsk Steel**	–	0,00
				États-Unis			
				2.336	Sequoia Pine Investment**	1.111.983	0,02
				Total des actions ordinaires		2.166.244	0,04
				Total des autres valeurs mobilières		2.166.244	0,04
				Total du portefeuille		4.682.129.698	96,72
				Autres éléments de l'actif net		158.746.679	3,28
				Total de l'actif net (USD)		4.840.876.377	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	776.000	USD	528.739	State Street	16/10/2023	(25.301)
AUD	337.000	USD	216.576	Morgan Stanley	16/10/2023	2.056
CAD	4.131.000	USD	3.134.740	Royal Bank of Canada	16/10/2023	(79.318)
CAD	124.000	USD	94.196	Morgan Stanley	16/10/2023	(2.481)
CHF	61.000	USD	70.034	Deutsche Bank	16/10/2023	(648)
EUR	1.000	USD	1.101	HSBC Bank	16/10/2023	(14)
EUR	73.000	USD	80.385	Citigroup	16/10/2023	(1.020)
EUR	73.000	USD	80.773	Bank of America	16/10/2023	(1.408)
EUR	74.000	USD	81.481	State Street	16/10/2023	(1.029)
GBP	119.000	USD	155.915	Royal Bank of Canada	16/10/2023	(5.043)
GBP	1.000	USD	1.271	Morgan Stanley	16/10/2023	(3)
GBP	168.000	USD	214.539	State Street	16/10/2023	(1.543)
HKD	1.462.000	USD	187.433	Barclays	16/10/2023	(658)
JPY	213.403.000	USD	1.564.384	Royal Bank of Canada	16/10/2023	(94.260)
JPY	116.976.000	USD	808.023	Morgan Stanley	16/10/2023	(2.181)
KRW	570.687.000	USD	440.859	Barclays	16/10/2023	(8.651)
NZD	4.718.000	USD	2.971.991	Royal Bank of Canada	16/10/2023	(165.725)
SGD	160.000	USD	120.796	State Street	16/10/2023	(2.199)
USD	4.421.561	EUR	4.085.115	RBS	14/9/2023	(12.711)
USD	1.009.526	EUR	917.397	BNY Mellon	14/9/2023	13.717
USD	214.982	EUR	196.987	Bank of America	14/9/2023	1.158
USD	1.843.290	EUR	1.679.722	BNP Paribas	20/9/2023	19.471
USD	92.325	GBP	72.000	BNP Paribas	20/9/2023	1.047
USD	1.046.240	EUR	953.278	Toronto-Dominion	20/9/2023	11.184
USD	793.996	CHF	682.000	Royal Bank of Canada	16/10/2023	18.249
USD	21.249	EUR	19.000	Royal Bank of Canada	16/10/2023	592
USD	3.662.576	GBP	2.819.000	State Street	16/10/2023	88.555
USD	201.122	HKD	1.571.000	Goldman Sachs	16/10/2023	422
USD	901.618	AED	3.311.000	Goldman Sachs	16/10/2023	(100)
USD	534.196	CAD	700.000	BNY Mellon	16/10/2023	16.454
USD	226.365	AUD	328.000	Deutsche Bank	16/10/2023	13.572
USD	378.154	EUR	336.000	State Street	20/9/2023	13.331
USD	295.222	EUR	263.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	9.659
USD	40.658	GBP	31.000	Barclays	16/10/2023	1.355
USD	192.086	GBP	150.000	Deutsche Bank	16/10/2023	1.912
USD	121.026	EUR	109.000	Deutsche Bank	16/10/2023	2.523
USD	80.059	GBP	62.000	Morgan Stanley	20/9/2023	1.459
USD	415.946	GBP	325.000	BNY Mellon	20/9/2023	3.930
USD	541.768	EUR	490.000	State Street	16/10/2023	9.047
USD	86.413	CAD	115.000	HSBC Bank	16/10/2023	1.355
USD	72.686	CAD	97.000	Royal Bank of Canada	16/10/2023	941
USD	647.958	CAD	865.000	Barclays	16/10/2023	8.176
USD	156.630	GBP	123.000	Standard Chartered Bank	20/9/2023	697
USD	40.043.671	GBP	31.510.000	Barclays	15/9/2023	98.020
USD	45.813	CHF	40.000	State Street	15/9/2023	469
USD	124.354.169	EUR	113.630.000	BNY Mellon	15/9/2023	1.006.168
USD	48.289.033	EUR	44.130.000	Morgan Stanley	15/9/2023	384.894
USD	10.944	EUR	10.000	Barclays	15/9/2023	89
USD	320.714	CAD	432.000	Deutsche Bank	16/10/2023	1.193
USD	666.807	EUR	610.000	State Street	15/9/2023	4.638
USD	246.805	HKD	1.931.000	HSBC Bank	16/10/2023	113
USD	2.588.991	AUD	4.031.000	Citigroup	16/10/2023	(26.160)
USD	162.042	AED	595.000	Morgan Stanley	16/10/2023	-
USD	215.666	EUR	197.000	Morgan Stanley	16/10/2023	1.490
USD	341.560	CAD	462.000	Morgan Stanley	16/10/2023	(151)
Plus-value nette non réalisée						1.307.332

Global Multi-Asset Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	159.513.340	USD	103.886.891	BNY Mellon	15/9/2023	(519.816)
USD	9.590.231	AUD	14.908.282	BNY Mellon	15/9/2023	(70.514)
Moins-value nette non réalisée						(590.330)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	16.208.231	USD	12.052.367	BNY Mellon	15/9/2023	(69.592)
USD	378.098	CAD	510.323	BNY Mellon	15/9/2023	817
Moins-value nette non réalisée						(68.775)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	2.379.237	USD	2.724.302	BNY Mellon	15/9/2023	(27.193)
USD	55.665	CHF	48.812	BNY Mellon	15/9/2023	331
Moins-value nette non réalisée						(26.862)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	56.294.167	USD	7.799.747	BNY Mellon	15/9/2023	(57.655)
USD	583.027	CNY	4.241.725	BNY Mellon	15/9/2023	(331)
Moins-value nette non réalisée						(57.986)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	661.901.902	USD	726.198.490	BNY Mellon	15/9/2023	(7.684.527)
USD	16.019.605	EUR	14.692.271	BNY Mellon	15/9/2023	70.766
Moins-value nette non réalisée						(7.613.761)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	36.100.783	USD	45.935.263	BNY Mellon	15/9/2023	(169.806)
USD	1.436.986	GBP	1.130.955	BNY Mellon	15/9/2023	3.257
Moins-value nette non réalisée						(166.549)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	460.712.984	USD	59.030.656	BNY Mellon	15/9/2023	(256.879)
USD	1.533.517	HKD	11.993.518	BNY Mellon	15/9/2023	3.489
Moins-value nette non réalisée						(253.390)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	33.240.382	USD	20.080.623	BNY Mellon	15/9/2023	(310.396)
USD	268.868	NZD	452.663	BNY Mellon	15/9/2023	(360)
Moins-value nette non réalisée						(310.756)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	557.335.275	USD	414.058.640	BNY Mellon	15/9/2023	(1.534.430)
USD	10.404.650	SGD	14.106.712	BNY Mellon	15/9/2023	(36.710)
Moins-value nette non réalisée						(1.571.140)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.664.543.827)						(9.352.217)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(1.916)	USD	GBP/USD Future	Septembre 2023	151.819.050	(547.518)
(237)	USD	JPY/USD Future	Septembre 2023	20.316.825	1.033.115
44	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	2.167.660	(16.639)
52	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	2.561.780	(63.464)
(714)	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	161.926.275	(3.556.341)
(28)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	3.403.750	(42.437)
(67)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	7.429.672	(55.484)
4.569	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	506.659.266	4.314.223
9	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	961.242	5.950

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Global Multi-Asset Income Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
4.772	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	509.671.966	2.937.471
25	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	2.670.117	19.531
1.872	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	217.122.750	2.325.378
(78)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	10.098.563	(157.828)
(4)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	517.875	(6.924)
Total				1.597.326.791	6.189.033

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR (96.446)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2026	(1.131)	2.941
CDS	EUR (290.000)	Fund provides default protection on Tkagr; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/12/2023	9.556	603
CDS	EUR (140.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2026	10.160	4.269
CDS	EUR (430.000)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	407	(106.636)
CDS	EUR (30.644)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	3.290	(1.399)
CDS	EUR (387.000)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	14.593	(23.114)
CDS	EUR (227.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2026	16.525	10.251
CDS	EUR (93.749)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(1.329)	2.859
CDS	EUR (200.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(2.170)	6.098
CDS	EUR (190.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes Finance; and receives Fixed 1%	Credit Suisse	20/12/2026	10.145	(2.797)
CDS	EUR (450.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	32.159	53.223
CDS	EUR (590.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	Credit Suisse	20/6/2027	68.636	(12.883)
CDS	EUR (109.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2026	(2.013)	3.324
CDS	EUR (146.356)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	17.506	(6.680)
CDS	USD (1.390.000)	Fund provides default protection on Bank Of America; and receives Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	22.396	13.373
CDS	EUR (312.000)	Fund provides default protection on K And S 500; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	18.252	51.948
CDS	EUR (98.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	3.340	(3.961)
CDS	USD 20.388.035	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.40; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(72.541)	(321.975)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 26.267.714)					147.781	(330.556)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
47.372	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.425	20/10/2023	(737.633)	1.784.926
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 63.414.337)						(737.633)	1.784.926

Global Multi-Asset Income Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(47.372)	Put	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.125	20/10/2023	460.224	(557.539)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 16.457.275)						460.224	(557.539)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Égypte			
352.179	Commercial International Bank Egypt	HSBC Bank	72.145
(352.179)	Commercial International Bank Egypt	HSBC Bank	(69.636)
			2.509
Pays-Bas			
161.573	X5 Retail**	JP Morgan	573.584
			573.584
Vietnam			
317.500	Vietnam Dairy Products JSC	HSBC Bank	28.621
			28.621
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.898.482)			604.714

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Impact Bond Fund⁽²⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 400.000	Saudi Electricity Sukuk Programme 4,632% 11/4/2033	360.114	0,47
OBLIGATIONS						726.975	0,95
Australie				Chili			
USD 135.000	FMG Resources August 2006 6,125% 15/4/2032	115.863	0,15	CLP 200.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 7% 1/5/2034	243.172	0,32
AUD 600.000	New South Wales Treasury 2,5% 22/11/2032	302.459	0,40	USD 200.000	Celulosa Arauco y Constitucion 4,2% 29/1/2030	163.608	0,22
AUD 600.000	Queensland Treasury 1,5% 2/3/2032	283.561	0,37	USD 500.000	Chile Government International Bond 3,1% 7/5/2041	335.259	0,44
AUD 280.000	Queensland Treasury 4,5% 9/3/2033	166.740	0,22	USD 300.000	Chile Government International Bond 3,5% 25/1/2050	200.331	0,26
AUD 450.000	Treasury of Victoria 2% 17/9/2035	197.497	0,26	USD 500.000	Inversiones CMPC 4,375% 4/4/2027	438.218	0,57
		1.066.120	1,40			1.380.588	1,81
Autriche				Chine			
EUR 100.000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 4,125% 18/1/2027	98.698	0,13	USD 200.000	Industrial & Commercial Bank of China 1,625% 28/10/2026	165.326	0,22
EUR 358.000	Republic of Austria Government Bond 1,85% 23/5/2049	271.024	0,36				
		369.722	0,49	République tchèque			
Belgique				EUR 200.000	UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia 3,75% 20/6/2028	198.696	0,26
EUR 300.000	Argenta Spaarbank 1,375% 8/2/2029	255.750	0,33	Danemark			
EUR 100.000	Argenta Spaarbank 5,375% 29/11/2027	101.275	0,13	EUR 375.000	Danske Bank 4,125% 10/1/2031	375.469	0,49
EUR 200.000	Belfius Bank 3,875% 12/6/2028	199.680	0,26	EUR 325.000	Danske Bank 4,75% 21/6/2030	327.925	0,43
EUR 500.000	KBC 0,25% 1/3/2027	455.114	0,60	DKK 1.200.000	Denmark Government Bond 0% 15/11/2031	129.977	0,17
EUR 795.000	Kingdom of Belgium Government Bond 2,75% 22/4/2039	734.350	0,96	EUR 130.000	Kommunekredit 0,125% 26/9/2040	75.830	0,10
		1.746.169	2,28	EUR 345.000	Orsted 1,75% 9/12/3019	292.689	0,39
Bermudes				EUR 300.000	Orsted 2,875% 14/6/2033	272.682	0,36
USD 300.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4,85% 14/10/2038	243.298	0,32	GBP 135.000	Orsted 4,875% 12/1/2032	147.136	0,19
Brésil				GBP 100.000	Orsted 5,125% 13/9/2034	109.554	0,14
USD 200.000	Banco do Brasil 6,25% 18/4/2030	183.078	0,24	EUR 100.000	Orsted 5,25% 8/12/3022	98.110	0,13
Canada						1.829.372	2,40
USD 22.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,5% 15/2/2029	17.753	0,02	Finlande			
USD 50.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,875% 15/1/2028	41.978	0,06	EUR 300.000	OP Corporate Bank 0,625% 27/7/2027	262.867	0,34
USD 15.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 5,75% 15/4/2025	13.740	0,02	France			
CAD 2.460.000	Canadian Government Bond 2,25% 1/12/2029	1.542.914	2,02	EUR 3.200.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 0,125% 29/9/2031	2.484.064	3,25
EUR 850.000	CPPIB Capital 0,875% 6/2/2029	747.789	0,98	EUR 500.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 2,875% 21/1/2030	488.013	0,64
USD 85.000	Royal Bank of Canada 1,15% 14/7/2026	69.673	0,09	EUR 400.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 3,5% 25/2/2033	404.120	0,53
		2.433.847	3,19	EUR 510.000	AXA 1,375% 7/10/2041	395.217	0,52
Îles Caïmans				EUR 200.000	Banque Federative du Credit Mutuel 4% 21/11/2029	199.774	0,26
USD 200.000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	182.310	0,24	EUR 100.000	BPCE 0,5% 14/1/2028	87.613	0,12
USD 200.000	Gaci First Investment 5,25% 13/10/2032	184.551	0,24	EUR 100.000	BPCE 5,75% 1/6/2033	101.228	0,13
				EUR 600.000	BPCE SFH 0,01% 27/5/2030	480.660	0,63
				EUR 200.000	Bpifrance 0% 25/5/2028	172.414	0,23
				EUR 500.000	Caisse des Depots et Consignations 3% 25/11/2027	495.897	0,65
				EUR 400.000	Credit Agricole 4% 12/10/2026	399.374	0,52
				EUR 1.300.000	Credit Agricole Home Loan SFH 0,05% 6/12/2029	1.063.123	1,39
				EUR 200.000	Credit Agricole Home Loan SFH 3,25% 8/6/2033	197.592	0,26
				EUR 100.000	Electricite de France 1% 29/11/2033	73.985	0,10
				EUR 200.000	Engie 1,375% 21/6/2039	133.712	0,17

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Impact Bond Fund⁽²⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 100.000	Engie 4% 11/1/2035	98.771	0,13	USD 200.000	Xiaomi Best Time International 4,1% 14/7/2051	110.272	0,14
EUR 642.414	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/6/2044	372.677	0,49			483.707	0,63
EUR 900.000	La Banque Postale Home Loan SFH 3% 31/1/2031	881.618	1,16		Inde		
EUR 500.000	Orange 0,125% 16/9/2029	411.441	0,54	EUR 200.000	Power Finance 1,841% 21/9/2028	168.530	0,22
EUR 100.000	Orange 2,375% 18/5/2032	91.086	0,12		International		
EUR 100.000	Region of Ile de France 1,375% 20/6/2033	83.477	0,11	USD 500.000	Asian Development Bank 4% 12/1/2033	451.322	0,59
EUR 200.000	SNCF Réseau 2,25% 20/12/2047	149.741	0,20	EUR 200.000	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 3,125% 9/11/2031	198.391	0,26
EUR 200.000	Societe Du Grand Paris EPIC 1% 18/2/2070	78.470	0,10	EUR 475.000	European Investment Bank 0% 15/5/2028	412.817	0,54
EUR 1.200.000	Societe Du Grand Paris EPIC 1,125% 25/5/2034	949.026	1,24	EUR 290.000	European Investment Bank 1% 14/11/2042	193.995	0,26
EUR 400.000	Societe Generale SFH 0,01% 11/2/2030	324.114	0,42	EUR 601.000	European Investment Bank 1,5% 15/11/2047	420.081	0,55
EUR 200.000	Societe Generale SFH 0,125% 18/7/2029	166.431	0,22	USD 200.000	European Investment Bank 3,75% 14/2/2033	177.585	0,23
EUR 100.000	UNEDIC ASSEO 0% 19/11/2030	80.586	0,11	GBP 500.000	European Investment Bank 3,875% 12/4/2028	559.536	0,73
EUR 100.000	Veolia Environnement 2,25% 20/1/2026	91.050	0,12	EUR 745.000	European Union 0% 2/6/2028	647.368	0,85
EUR 100.000	Veolia Environnement 2,5% 20/1/2029	83.300	0,11	EUR 550.000	European Union 0% 4/7/2029	463.045	0,61
		11.038.574	14,47	EUR 795.000	European Union 0,2% 4/6/2036	545.092	0,71
	Allemagne			EUR 2.155.000	European Union 0,3% 4/11/2050	1.015.263	1,33
EUR 300.000	Bayerische Landesbank 1,375% 22/11/2032	240.050	0,31	EUR 1.185.000	European Union 1,25% 4/2/2043	832.024	1,09
EUR 365.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,3% 15/2/2033	360.235	0,47	EUR 815.523	European Union 2,625% 4/2/2048	721.303	0,95
USD 250.000	Deutsche Bank 1,686% 19/3/2026	209.234	0,27	EUR 455.000	European Union 2,75% 4/2/2033	442.797	0,58
EUR 400.000	Deutsche Bank 1,875% 23/2/2028	359.200	0,47	EUR 453.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,125% 3/1/2051	194.539	0,26
EUR 100.000	Deutsche Pfandbriefbank 0,1% 2/2/2026	88.786	0,12	USD 950.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,625% 22/4/2025	814.181	1,07
EUR 125.000	E.ON 3,875% 12/1/2035	122.582	0,16	EUR 160.000	International Bank for Reconstruction & Development 0,7% 22/10/2046	93.051	0,12
EUR 100.000	Evonik Industries 1,375% 2/9/2081	83.414	0,11	USD 2.805.000	International Bank for Reconstruction & Development 1,375% 20/4/2028	2.258.896	2,96
EUR 374.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0% 15/6/2029*	315.760	0,41	EUR 317.000	International Development Association 0,7% 17/1/2042	201.428	0,26
EUR 420.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0% 15/9/2031	331.756	0,44			10.642.714	13,95
JPY 70.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,6% 20/6/2037	537.681	0,70		Irlande		
EUR 300.000	Landesbank Baden-Wuerttemberg 0,25% 21/7/2028	250.327	0,33	EUR 100.000	AIB 4,625% 23/7/2029	99.642	0,13
EUR 105.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0% 30/6/2031	83.161	0,11	EUR 136.708	Ireland Government Bond 3% 18/10/2043	131.506	0,17
EUR 24.000	NRW Bank 0% 18/2/2030	19.677	0,03			231.148	0,30
EUR 48.000	NRW Bank 0,1% 9/7/2035	33.240	0,04		Italie		
EUR 120.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0,5% 25/11/2039	77.848	0,10	EUR 150.000	A2A 1% 2/11/2033	108.209	0,14
EUR 185.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 2,25% 14/6/2052	149.212	0,20	EUR 100.000	A2A 4,375% 3/2/2034	98.761	0,13
EUR 200.000	Vonovia 0,625% 24/3/2031	144.808	0,19	EUR 200.000	Cassa Depositi e Prestiti 2% 20/4/2027	187.402	0,24
EUR 100.000	Vonovia 5% 23/11/2030	98.080	0,13	EUR 235.000	Intesa Sanpaolo 0,75% 4/12/2024	225.584	0,30
		3.505.051	4,59	EUR 250.000	Intesa Sanpaolo 4,875% 19/5/2030	252.005	0,33
	Hong Kong			EUR 642.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,5% 30/4/2045	386.955	0,51
USD 200.000	Hong Kong Government International Bond 4,625% 11/1/2033	187.819	0,25	EUR 341.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4% 30/10/2031	343.695	0,45
USD 200.000	Lenovo 6,536% 27/7/2032	185.616	0,24				

*Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Impact Bond Fund⁽²⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 319.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4% 30/4/2035*	313.592	0,41	GBP 500.000	ING Groep 1,125% 7/12/2028	475.084	0,62
EUR 160.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0,75% 24/7/2032	123.960	0,16	EUR 400.000	ING Groep 4,125% 24/8/2033	379.600	0,50
		2.040.163	2,67	EUR 714.000	Nederlandse Waterschapsbank 0,25% 19/1/2032	563.792	0,74
				EUR 629.260	Netherlands Government Bond 0,5% 15/1/2040	434.312	0,57
	Japon			EUR 100.000	NN 5,25% 1/3/2043	95.750	0,13
USD 60.000	Honda Motor 2,967% 10/3/2032	48.367	0,07	EUR 125.000	NN 6% 3/11/2043	125.406	0,17
USD 150.000	Toyota Motor 5,118% 13/7/2028	139.520	0,18	EUR 100.000	TenneT 1,125% 9/6/2041	70.261	0,09
		187.887	0,25	EUR 120.000	TenneT 1,5% 3/6/2039	89.104	0,12
				EUR 475.000	TenneT 4,5% 28/10/2034	502.467	0,66
				EUR 200.000	Thermo Fisher Scientific Finance I 0,8% 18/10/2030	163.838	0,21
						7.538.426	9,88
	Jersey				Nouvelle-Zélande		
USD 85.000	Aptiv 3,1% 1/12/2051	47.818	0,06	NZD 460.000	New Zealand Government Bond 4,25% 15/5/2034	238.574	0,31
USD 75.000	Aptiv 4,35% 15/3/2029	66.550	0,09				
		114.368	0,15		Norvège		
				EUR 340.000	DNB Boligkreditt 0,01% 21/1/2031	266.781	0,35
	Luxembourg						
EUR 325.000	Prologis International Funding II 0,875% 9/7/2029	262.532	0,34		Pérou		
USD 200.000	Rumo Luxembourg 5,25% 10/1/2028	173.411	0,23	PEN 1.020.000	Peru Government Bond 7,3% 12/8/2033	265.113	0,35
EUR 400.000	Segro Capital 1,25% 23/3/2026	371.030	0,49	USD 260.000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034*	194.662	0,25
		806.973	1,06			459.775	0,60
	Malaisie				Philippines		
MYR 420.000	Malaysia Government Investment Issue 4,662% 31/3/2038	89.618	0,12	USD 200.000	Philippine Government International Bond 5,95% 13/10/2047	195.546	0,26
	Mexique				Portugal		
MXN 2.500.000	Mexican Bonos 8% 24/5/2035	125.160	0,16	EUR 100.000	EDP - Energias de Portugal 3,875% 26/6/2028	100.319	0,13
EUR 190.000	Mexico Government International Bond 1,35% 18/9/2027	171.694	0,23				
EUR 260.000	Mexico Government International Bond 2,25% 12/8/2036	189.043	0,25		Singapour		
USD 650.000	Mexico Government International Bond 4,875% 19/5/2033	568.425	0,74	USD 184.000	Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	167.056	0,22
		1.054.322	1,38	SGD 295.000	Singapore Government Bond 3% 1/8/2072	201.404	0,26
						368.460	0,48
	Pays-Bas				Corée du Sud		
EUR 210.000	ABN AMRO Bank 0,875% 22/4/2025	200.224	0,26	AUD 100.000	Industrial Bank of Korea 3,261% 17/3/2027	55.569	0,07
EUR 300.000	ABN AMRO Bank 4% 16/1/2028	296.196	0,39	EUR 1.060.000	Korea International Bond 0% 15/10/2026	946.437	1,24
EUR 300.000	ABN AMRO Bank 4,25% 21/2/2030	297.788	0,39	USD 200.000	POSCO 2,75% 15/7/2024	179.491	0,24
EUR 350.000	Alliander 3,25% 13/6/2028	346.456	0,45	USD 200.000	SK Hynix 6,5% 17/1/2033	186.877	0,24
EUR 578.000	BNG Bank 0,25% 12/1/2032	456.381	0,60			1.368.374	1,79
EUR 500.000	BNG Bank 3% 11/1/2033*	493.018	0,64		Espagne		
EUR 300.000	Compass Finance Netherlands 3% 8/3/2030	286.418	0,38	EUR 100.000	Adif Alta Velocidad 3,9% 30/4/2033	100.737	0,13
USD 310.000	Cooperatieve Rabobank 1,004% 24/9/2026	258.299	0,34	EUR 150.000	Autonomous Community of Madrid Spain 0,419% 30/4/2030	122.849	0,16
EUR 300.000	de Volksbank 2,375% 4/5/2027	282.564	0,37	EUR 290.000	Autonomous Community of Madrid Spain 0,827% 3 0/7/2027	262.946	0,35
EUR 300.000	de Volksbank 4,625% 23/11/2027	299.906	0,39	EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 0,75% 4/6/2025	189.092	0,25
EUR 215.000	Digital Intrepid 0,625% 15/7/2031	155.580	0,20	EUR 100.000	CaixaBank 0,75% 26/5/2028	87.029	0,11
EUR 265.000	EDP Finance 0,375% 16/9/2026	240.107	0,32	EUR 400.000	CaixaBank 5,375% 14/11/2030	412.182	0,54
EUR 50.000	EnBW International Finance 4,049% 22/11/2029	50.564	0,07	EUR 620.000	Spain Government Bond 1% 30/7/2042	380.692	0,50
EUR 200.000	Enexis 3,625% 12/6/2034	199.761	0,26			1.555.527	2,04
EUR 800.000	Iberdrola International 1,45% 9/11/2026	697.200	0,91				
EUR 100.000	Iberdrola International 1,825% 9/8/2029	78.350	0,10				

*Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Impact Bond Fund⁽²⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Suède				USD 200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6%	180.725	0,24
EUR 300.000	Skandinaviska Enskilda Banken 0,75% 9/8/2027	264.343	0,35	USD 15.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625%	11.923	0,02
EUR 150.000	Skandinaviska Enskilda Banken 4% 9/11/2026	149.640	0,19	1/8/2029			
EUR 550.000	Swedbank 0,3% 20/5/2027	493.075	0,65	USD 70.000	Autodesk 2,4% 15/12/2031	52.390	0,07
SEK 4.000.000	Sweden Government International Bond 0,125% 9/9/2030	282.558	0,37	USD 50.000	AvalonBay Communities 2,05% 15/1/2032	36.962	0,05
		1.189.616	1,56	USD 54.000	Ball 2,875% 15/8/2030	40.626	0,05
Suisse				USD 29.000	Ball 4,875% 15/3/2026	25.976	0,03
EUR 1.130.000	Credit Suisse 0,45% 19/5/2025	1.060.137	1,39	USD 32.000	Ball 5,25% 1/7/2025	29.162	0,04
CHF 225.000	Swiss Confederation Government Bond 1,5% 26/10/2038	252.852	0,33	USD 540.000	Bank of America 2,456% 22/10/2025	478.429	0,63
		1.312.989	1,72	EUR 150.000	Bank of America 4,134% 12/6/2028	149.858	0,20
Émirats arabes unis				USD 240.000	Bank of America 6,204% 10/11/2028	226.099	0,30
USD 500.000	Abu Dhabi Commercial Bank 4,5% 14/9/2027	448.133	0,59	USD 8.000	Beazer Homes USA 5,875% 15/10/2027	6.945	0,01
Royaume-Uni				USD 5.000	Beazer Homes USA 6,75% 15/3/2025	4.579	0,01
GBP 100.000	Anglian Water Services Financing 6% 20/6/2039	116.415	0,15	USD 8.000	Berry Global 4,5% 15/2/2026	7.033	0,01
EUR 300.000	DS Smith 4,375% 27/7/2027	300.597	0,39	USD 14.000	Berry Global 5,625% 15/7/2027	12.665	0,02
EUR 300.000	DS Smith 4,5% 27/7/2030	298.158	0,39	USD 35.000	CenterPoint Energy Houston Electric 5,3% 1/4/2053	32.128	0,04
EUR 250.000	National Grid 3,875% 16/1/2029	248.239	0,33	USD 575.000	Citigroup 2,014% 25/1/2026	501.350	0,66
GBP 200.000	NatWest 2,057% 9/11/2028	196.422	0,26	USD 175.000	City of San Francisco Public Utilities Commission Water Revenue 6% 1/11/2040	169.205	0,22
USD 95.000	Royalty Pharma 1,2% 2/9/2025	79.725	0,10	USD 180.000	Commonwealth of Massachusetts 3,769% 15/7/2029	158.070	0,21
EUR 200.000	SSE 4% 21/1/2028	185.012	0,24	USD 32.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	25.394	0,03
EUR 280.000	Thames Water Utilities Finance 4% 18/4/2027	268.100	0,35	USD 16.000	Covanta 5% 1/9/2030	12.532	0,02
EUR 425.000	Thames Water Utilities Finance 4,375% 18/1/2031	400.562	0,53	USD 49.000	Dana 4,25% 1/9/2030	37.129	0,05
GBP 1.700.000	United Kingdom Gilt 0,875% 31/7/2033	1.431.184	1,88	USD 53.000	Darling Ingredients 5,25% 15/4/2027	47.566	0,06
GBP 1.030.000	United Kingdom Gilt 1,5% 31/7/2053	604.614	0,79	USD 21.000	Darling Ingredients 6% 15/6/2030	18.963	0,03
		4.129.028	5,41	USD 130.000	Dominion Energy 2,25% 15/8/2031	95.540	0,12
États-Unis				USD 100.000	DTE Electric 1,9% 1/4/2028	80.863	0,11
USD 29.000	AECOM 5,125% 15/3/2027	25.665	0,03	USD 60.000	DTE Electric 3,95% 1/3/2049	44.058	0,06
USD 105.000	AES 1,375% 15/1/2026	87.043	0,11	USD 190.000	Duke Energy Carolinas 3,95% 15/11/2028	166.672	0,22
USD 130.000	AES 2,45% 15/1/2031	95.217	0,12	USD 250.000	Duke Energy Florida 2,4% 15/12/2031	188.258	0,25
USD 400.000	AES 5,45% 1/6/2028	361.331	0,47	USD 210.000	Duke Energy Florida 2,5% 1/12/2029	166.922	0,22
USD 24.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,25% 15/3/2026	20.589	0,03	USD 45.000	Duke Energy Florida 3% 15/12/2051	27.208	0,03
USD 45.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,625% 15/1/2027	39.271	0,05	USD 150.000	Duke Energy Progress 3,45% 15/3/2029	127.036	0,17
USD 24.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5,875% 15/2/2028	21.483	0,03	USD 170.000	East Bay Municipal Utility District Water System Revenue 5,874% 1/6/2040	168.637	0,22
USD 290.000	Alexandria Real Estate Equities 2% 18/5/2032	202.703	0,26	USD 105.000	Ecolab 1,3% 30/1/2031	75.413	0,10
USD 115.000	Alexandria Real Estate Equities 3,8% 15/4/2026	101.686	0,13	USD 18.000	Equinix 2,15% 15/7/2030	13.403	0,02
USD 300.000	American Tower 3,65% 15/3/2027	259.317	0,34	USD 390.000	Equinix 2,5% 15/5/2031	290.911	0,38
USD 125.000	American Tower 4,05% 15/3/2032	102.791	0,13	USD 60.000	ERP Operating 1,85% 1/8/2031	43.307	0,06
USD 90.000	Amgen 2,45% 21/2/2030	70.588	0,09	USD 867.072	Fannie Mae Pool 3,5% 1/7/2051	717.771	0,94
USD 20.000	Amgen 4,563% 15/6/2048	15.693	0,02	USD 152.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	133.717	0,18
USD 100.000	Amgen 5,25% 2/3/2033	91.728	0,12	USD 170.000	General Motors 5,6% 15/10/2032	150.767	0,20
USD 250.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4,75% 23/1/2029	228.115	0,30	USD 110.000	Georgia Power 3,25% 1/4/2026	96.178	0,13
				USD 1.346.556	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2048	1.158.594	1,52
				USD 310.000	Goldman Sachs 4,387% 15/6/2027	277.208	0,36

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Impact Bond Fund⁽²⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 213.516	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-4 5,3% 20/11/2054	184.730	0,24	USD 250.000	Pacific Gas and Electric 6,7% 1/4/2053	224.952	0,29
USD 195.000	Healthpeak 2,125% 1/12/2028	153.461	0,20	USD 90.000	PacifiCorp 2,9% 15/6/2052	49.035	0,06
USD 37.000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	29.576	0,04	USD 20.000	PacifiCorp 5,35% 1/12/2053	15.942	0,02
USD 33.000	Hilton Domestic Operating 4,875% 15/1/2030	28.393	0,04	USD 35.000	PacifiCorp 5,5% 15/5/2054	28.654	0,04
USD 17.000	Hilton Domestic Operating 5,75% 1/5/2028	15.387	0,02	USD 175.000	Pfizer 1,75% 18/8/2031	129.916	0,17
USD 20.000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4,875% 1/4/2027	17.804	0,02	USD 57.000	Post 4,625% 15/4/2030	46.590	0,06
USD 100.000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust 2,835% 10/8/2038	83.707	0,11	USD 34.000	Post 5,625% 15/1/2028	30.242	0,04
USD 125.000	Hyundai Capital America 5,8% 26/6/2025	115.288	0,15	USD 16.000	Post 5,75% 1/3/2027	14.431	0,02
USD 40.000	Interstate Power and Light 3,5% 30/9/2049	26.061	0,03	USD 200.000	Prologis 1,25% 15/10/2030	141.914	0,19
USD 80.000	Interstate Power and Light 4,1% 26/9/2028	70.201	0,09	USD 60.000	Prologis 4,625% 15/1/2033	53.082	0,07
USD 12.000	KB Home 4% 15/6/2031	9.276	0,01	USD 90.000	Prudential Financial 1,5% 10/3/2026	75.967	0,10
USD 9.000	KB Home 4,8% 15/11/2029	7.518	0,01	USD 105.000	Public Service Electric and Gas 3,1% 15/3/2032	84.011	0,11
USD 9.000	KB Home 6,875% 15/6/2027	8.386	0,01	USD 145.000	Public Service Electric and Gas 4,65% 15/3/2033	129.603	0,17
USD 11.000	KB Home 7,25% 15/7/2030	10.225	0,01	USD 375.000	Regency Centers 3,75% 15/6/2024	338.637	0,44
USD 80.000	Kimco Realty 2,7% 1/10/2030	60.902	0,08	USD 165.000	Republic Services 4,875% 1/4/2029	149.871	0,20
USD 300.000	Kraft Heinz Foods 3,75% 1/4/2030	253.445	0,33	USD 210.000	Southern California Edison 2,5% 1/6/2031	159.375	0,21
USD 150.000	Los Angeles Unified School District 5,75% 1/7/2034	144.432	0,19	USD 170.000	Southern California Edison 3,65% 1/6/2051	112.093	0,15
USD 320.000	Metropolitan Life Global Funding 1 4,4% 30/6/2027	285.160	0,37	USD 260.000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/10/2031	193.219	0,25
USD 70.000	MidAmerican Energy 3,15% 15/4/2050	43.751	0,06	USD 100.000	Toyota Motor Credit 2,15% 13/2/2030	78.424	0,10
USD 380.000	MidAmerican Energy 3,65% 15/4/2029	326.090	0,43	USD 330.000	Verizon Communications 1,5% 18/9/2030	237.662	0,31
USD 55.000	MidAmerican Energy 4,25% 15/7/2049	41.763	0,05	USD 60.000	Verizon Communications 3,875% 1/3/2052	41.513	0,06
USD 225.000	Morgan Stanley 0,864% 21/10/2025	195.175	0,26	USD 265.000	Wells Fargo 4,54% 15/8/2026	238.409	0,31
USD 175.000	New York City Municipal Water Finance Authority 5,44% 15/6/2043	167.052	0,22	USD 70.000	Welltower 2,7% 15/2/2027	59.166	0,08
USD 210.000	NextEra Energy Capital 1,9% 15/6/2028	166.188	0,22	USD 60.000	Wisconsin Power and Light 4,95% 1/4/2033	53.661	0,07
USD 90.000	Northern States Power 2,25% 1/4/2031	68.729	0,09	USD 40.000	Wisconsin Public Service 2,85% 1/12/2051	23.374	0,03
USD 95.000	Northern States Power 2,9% 1/3/2050	57.761	0,08	USD 50.000	WRKCo 3,375% 15/9/2027	42.513	0,06
USD 60.000	Northern States Power 4,5% 1/6/2052	47.814	0,06	USD 30.000	WRKCo 4,2% 1/6/2032	25.196	0,03
USD 85.000	NSTAR Electric 3,95% 1/4/2030	73.087	0,10	USD 44.000	Yum! Brands 3,625% 15/3/2031	34.412	0,04
USD 130.000	Oncor Electric Delivery 4,15% 1/6/2032	112.320	0,15	USD 45.000	Yum! Brands 4,625% 31/1/2032	37.114	0,05
USD 16.000	Owens-Brockway Glass Container 7,25% 15/5/2031	14.828	0,02	USD 31.000	Yum! Brands 4,75% 15/1/2030	26.349	0,03
						13.705.229	17,97
				Total des obligations		73.845.890	96,78
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		73.845.890	96,78
				Total du portefeuille		73.845.890	96,78
				Autres éléments de l'actif net		2.453.414	3,22
				Total de l'actif net (EUR)		76.299.304	100,00

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Impact Bond Fund⁽²⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
EUR	128.046	MXN	2.370.000	Goldman Sachs	5/9/2023	(2.452)
EUR	251.550	CHF	240.000	State Street	5/9/2023	1.074
EUR	1.578.974	CAD	2.300.000	HSBC Bank	5/9/2023	12.029
EUR	131.544	DKK	980.000	Goldman Sachs	5/9/2023	32
EUR	218.346	SGD	320.000	HSBC Bank	5/9/2023	145
EUR	1.022.120	AUD	1.690.000	State Street	5/9/2023	13.140
EUR	256.699	NZD	460.000	Goldman Sachs	5/9/2023	4.546
EUR	591.580	JPY	90.950.000	Morgan Stanley	5/9/2023	17.952
EUR	23.520.605	USD	25.921.000	HSBC Bank	5/9/2023	(369.767)
EUR	3.702.117	GBP	3.173.000	State Street	5/9/2023	(5.053)
EUR	300.434	SEK	3.480.000	HSBC Bank	5/9/2023	6.414
EUR	81.495	USD	90.000	Morgan Stanley	5/9/2023	(1.454)
EUR	654.168	USD	720.000	RBS	5/9/2023	(9.428)
EUR	1.004.168	AUD	1.690.000	State Street	3/10/2023	(4.483)
EUR	1.556.537	CAD	2.300.000	Goldman Sachs	3/10/2023	(8.960)
EUR	217.147	SGD	320.000	State Street	3/10/2023	(1.035)
EUR	251.383	NZD	460.000	Goldman Sachs	3/10/2023	(445)
EUR	293.992	SEK	3.480.000	HSBC Bank	3/10/2023	(37)
EUR	251.083	CHF	240.000	State Street	3/10/2023	184
EUR	129.027	MXN	2.370.000	Goldman Sachs	3/10/2023	(662)
EUR	24.229.558	USD	26.421.000	RBS	3/10/2023	(88.667)
EUR	131.537	DKK	980.000	RBS	3/10/2023	(12)
EUR	572.781	JPY	90.950.000	State Street	3/10/2023	(2.640)
EUR	3.684.833	GBP	3.173.000	State Street	3/10/2023	(17.789)
USD	189.232	CLP	153.830.000	BNP Paribas	20/9/2023	8.788
USD	95.965	MYR	440.000	Morgan Stanley	20/9/2023	947
USD	293.995	PEN	1.070.000	Goldman Sachs	20/9/2023	3.767
USD	100.947	CLP	85.000.000	Goldman Sachs	20/9/2023	1.527
USD	230.000	EUR	208.921	RBS	5/9/2023	3.061
USD	80.000	EUR	73.188	HSBC Bank	5/9/2023	545
Moins-value nette non réalisée						(438.733)
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	63	USD	68	BNY Mellon	15/9/2023	-
USD	5.130	EUR	4.676	BNY Mellon	15/9/2023	50
Plus-value nette non réalisée						50
Total des moins-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 66.789.891)						(438.683)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
(1)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	133.000	(2.010)
(1)	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	133.460	2.700
(2)	EUR	Euro BOBL	Décembre 2023	234.740	(820)
(1)	EUR	Euro BUXL	Décembre 2023	133.420	(980)
(5)	EUR	Euro-OAT	Décembre 2023	636.350	(4.900)
(16)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	1.635.336	(9.243)
(6)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	641.421	(11.449)
(1)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	119.332	(2.174)
(1)	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	111.384	(1.274)
(7)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	689.097	(5.041)
Total				4.467.540	(35.191)

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Impact Bond Fund⁽²⁾ suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 1.890.000	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.40; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(9.796)	(27.511)
CDS	EUR 855.000	Fund receives default protection on ITRAXX.EUR.39.V1; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(4.976)	(11.216)
CDS	USD 996.000	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and pays Fixed 5%	BNP Paribas	20/6/2028	(9.759)	(27.162)
IRS	EUR 147.122	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,3835%	BNP Paribas	1/2/2053	10.156	10.156
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 3.731.200)					(14.375)	(55.733)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

India Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				1.676.586	Marico	11.544.644	2,46
				140.544	Maruti Suzuki India	16.983.182	3,61
				9.649.552	Motherson Sumi Wiring India	7.238.365	1,54
				20.698	Navin Fluorine International	1.151.292	0,24
				395.853	Olectra Greentech	5.972.013	1,27
				465.048	One 97 Communications	4.796.744	1,02
				966.182	PB Fintech	9.040.787	1,92
				2.558.877	Power Grid of India	7.558.904	1,61
				1.315.497	Reliance Industries	38.247.909	8,14
				1.139.950	SBI Cards & Payment Services	11.243.728	2,39
				561.417	Tata Consultancy Services	22.764.220	4,85
				4.241.663	Tata Steel	6.296.944	1,34
				150.070	Tech Mahindra	2.178.823	0,46
				153.802	UltraTech Cement	15.415.172	3,28
				404.807	United Spirits	4.926.703	1,05
				310.662	Vedant Fashions	4.729.938	1,01
						453.347.202	96,51
				États-Unis			
				150.089	Cognizant Technology Solutions	10.759.880	2,29
				Total des actions ordinaires		464.107.082	98,80
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		464.107.082	98,80
				Total du portefeuille		464.107.082	98,80
				Autres éléments de l'actif net		5.646.511	1,20
				Total de l'actif net (USD)		469.753.593	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Finance	29,48
Biens de consommation non cyclique	18,39
Technologie	18,03
Biens de consommation cyclique	11,48
Énergie	8,14
Valeurs industrielles	7,93
Matériaux de base	3,74
Services aux collectivités	1,61
Autres éléments de l'actif net	1,20
	100,00

Japan Flexible Equity Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées JPY
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	48.762.629	JPY	7.626.266.707	BNY Mellon	15/9/2023	96.650.575
JPY	362.418.435	EUR	2.292.732	BNY Mellon	15/9/2023	(694.586)
Plus-value nette non réalisée						95.955.989
Catégorie d'Actions couverte en USD						
JPY	272.587.223	USD	1.884.215	BNY Mellon	15/9/2023	(2.319.565)
USD	18.988.637	JPY	2.708.685.145	BNY Mellon	15/9/2023	61.822.361
Plus-value nette non réalisée						59.502.796
Total des plus-values nettes non réalisées (JPY Exposition sous-jacente - JPY 11.173.562.593)						155.458.785

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation cyclique	30,73
Valeurs industrielles	18,72
Biens de consommation non cyclique	16,50
Finance	16,37
Technologie	8,30
Matériaux de base	3,56
Communications	2,95
Énergie	1,20
Autres éléments de l'actif net	1,67
	100,00

Japan Small & MidCap Opportunities Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (JPY)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (JPY)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				60.700	Nichirei	209.172.200	0,98
				76.200	Nippon Gas*	173.316.900	0,81
				681	NIPPON REIT Investment	236.988.000	1,11
				41.900	Nippon Soda	225.841.000	1,05
				166.600	Nisshinbo	180.427.800	0,84
				247.700	Nomura	211.783.500	0,99
				71.000	Nomura Real Estate*	260.428.000	1,21
				31.600	NS Solutions	124.820.000	0,58
				120.000	Okamura	260.880.000	1,22
				30.500	Otsuka	198.097.500	0,92
				50.600	PALTAC	243.031.800	1,13
				61.100	Rohto Pharmaceutical*	231.996.700	1,08
				19.700	Rorze*	228.717.000	1,07
				140.000	Round One	83.160.000	0,39
				40.700	Ryobi	115.506.600	0,54
				133.800	Ryohin Keikaku*	251.343.300	1,17
				14.900	Sakata Seed	62.729.000	0,29
				54.800	San-A	269.342.000	1,26
				53.700	Sega Sammy	156.186.450	0,73
				96.700	Seiren	232.563.500	1,08
				61.600	Shibaura Machine	259.952.000	1,21
				136.800	Ship Healthcare	338.785.200	1,58
				72.300	Sojitz*	226.443.600	1,06
				20.500	Sumitomo Metal Mining	92.660.000	0,43
				82.700	SWCC	162.505.500	0,76
				271.700	Take And Give Needs	298.598.300	1,39
				53.000	Tamron	238.765.000	1,11
				69.300	TBS	178.551.450	0,83
				91.100	Tokuyama*	211.898.600	0,99
				201.000	Tokyo Tatemono	384.915.000	1,79
				7.400	Toyo Gosei*	54.982.000	0,26
				35.000	Toyo Suisan Kaisha*	210.420.000	0,98
				31.000	Toyo Tanso*	184.760.000	0,86
				98.500	Toyoda Gosei*	310.176.500	1,45
				70.300	Tsumura	193.219.550	0,90
				58.600	UACJ	183.711.000	0,86
				1.964	United Urban Investment	307.366.000	1,43
				83.900	Valqua	364.126.000	1,70
				26.900	Visional*	206.054.000	0,96
				55.200	West*	156.271.200	0,73
				119.600	Yokogawa Bridge	330.215.600	1,54
				26.100	Zenkoku Hoshō*	131.726.700	0,61
				90.800	ZERIA Pharmaceutical	219.372.800	1,02
Total des actions ordinaires						20.904.661.470	97,44
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé						20.904.661.470	97,44
Total du portefeuille						20.904.661.470	97,43
Autres éléments de l'actif net						550.426.668	2,57
Total de l'actif net (JPY)						21.455.088.138	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Japan Small & MidCap Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées JPY
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	2.057.923	JPY	322.073.202	BNY Mellon	15/9/2023	3.855.799
JPY	8.710.167	EUR	55.119	BNY Mellon	15/9/2023	(19.415)
Plus-value nette non réalisée						3.836.384
Catégorie d'Actions couverte en USD						
JPY	93.598.273	USD	645.715	BNY Mellon	15/9/2023	(611.091)
USD	11.344.048	JPY	1.619.875.729	BNY Mellon	15/9/2023	35.256.943
Plus-value nette non réalisée						34.645.852
Total des plus-values nettes non réalisées (JPY Exposition sous-jacente - JPY 2.098.603.887)						38.482.236

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Valeurs industrielles	30,87
Finance	17,94
Biens de consommation cyclique	17,30
Biens de consommation non cyclique	14,21
Matériaux de base	6,27
Technologie	6,21
Communications	3,29
Services aux collectivités	0,73
Énergie	0,61
Autres éléments de l'actif net	2,57
	100,00

Latin American Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Brésil							
1.566.000	Alpargatas	2.857.483	0,30				
3.014.892	Ambev*	8.547.219	0,91				
12.404.498	Ambev	35.399.462	3,78				
1.469.884	Arezzo Industria e Comercio	21.907.294	2,34				
14.754.543	B3 - Brasil Bolsa Balcao	38.991.406	4,16				
11.798.873	Banco Bradesco*	35.632.596	3,81				
6.114.641	Banco Bradesco	18.554.288	1,98				
4.140.751	Banco BTG Pactual	27.079.261	2,89				
2.976.397	CCR	7.672.320	0,82				
3.719.027	Cyrela Brazil Realty Empreendimentos e Participacoes	17.225.710	1,84				
6.223.394	GRUPO DE MODA SOMA	9.764.251	1,04				
27.160.336	Hapvida Participacoes e Investimentos	24.256.044	2,59				
4.767.193	Itau Unibanco*	26.243.397	2,80				
1.746.540	Localiza Rent a Car	22.258.770	2,37				
1.617.165	Petroleo Brasileiro	23.076.944	2,47				
3.553.668	Petroleo Brasileiro*	46.659.661	4,98				
2.432.833	Petroleo Brasileiro	15.974.186	1,71				
1.451.667	Rede D'Or Sao Luiz	8.491.670	0,91				
5.299.404	Rumo	24.158.442	2,58				
10.933.321	Sendas Distribuidora	26.407.739	2,82				
1.168.511	Vale	15.688.983	1,68				
5.735.230	Vale*	76.938.111	8,21				
		533.785.237	56,99				
Canada							
2.037.496	MAG Silver	23.493.038	2,51				
Îles Caïmans							
1.553.252	Pageseguro Digital*	14.134.593	1,51				
				Chili			
1.004.513	Banco Santander Chile*	19.095.792	2,04				
407.171	Sociedad Quimica y Minera de Chile*	25.334.180	2,70				
		44.429.972	4,74				
				Colombie			
745.721	Bancolombia*	20.358.183	2,18				
110.790	Bancolombia	782.438	0,08				
		21.140.621	2,26				
				Luxembourg			
102.979	Globant*	21.298.117	2,27				
397.322	Tenaris*	12.905.019	1,38				
		34.203.136	3,65				
				Mexique			
1.093.913	America Movil	21.375.060	2,28				
16.540.217	Fibra Uno Administracion	25.390.237	2,71				
425.537	Fomento Economico Mexicano	50.055.917	5,35				
42.354	Grupo Aeroportuario del Pacifico	8.196.346	0,88				
1.494.096	Grupo Aeroportuario del Pacifico	28.881.134	3,08				
6.197.192	Grupo Financiero Banorte	54.823.253	5,85				
3.727.962	Grupo Mexico	18.326.284	1,96				
10.924.328	Wal-Mart de Mexico	44.603.362	4,76				
		251.651.593	26,87				
		922.838.190	98,53				
				Total des actions ordinaires et privilégiées			
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
		922.838.190	98,53				
				Total du portefeuille			
		922.838.190	98,53				
				Autres éléments de l'actif net			
		13.786.135	1,47				
				Total de l'actif net (USD)			
		936.624.325	100,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Latin American Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	5.713.441	USD	3.719.350	BNY Mellon	15/9/2023	(16.954)
USD	361.198	AUD	557.746	BNY Mellon	15/9/2023	(229)
Moins-value nette non réalisée						(17.183)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	439.612	USD	503.287	BNY Mellon	15/9/2023	(4.944)
USD	54.496	CHF	47.800	BNY Mellon	15/9/2023	312
Moins-value nette non réalisée						(4.632)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	1.272.114	USD	1.395.343	BNY Mellon	15/9/2023	(14.428)
USD	269.840	EUR	247.249	BNY Mellon	15/9/2023	1.446
Moins-value nette non réalisée						(12.982)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	2.388.647	USD	3.039.014	BNY Mellon	15/9/2023	(10.892)
USD	869.176	GBP	684.564	BNY Mellon	15/9/2023	1.343
Moins-value nette non réalisée						(9.549)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	1.850.876	USD	237.103	BNY Mellon	15/9/2023	(985)
USD	20.803	HKD	162.682	BNY Mellon	15/9/2023	50
Moins-value nette non réalisée						(935)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	29.998.318	USD	7.377.918	BNY Mellon	15/9/2023	(99.641)
USD	967.544	PLN	3.965.126	BNY Mellon	15/9/2023	5.509
Moins-value nette non réalisée						(94.132)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	6.475.339	USD	4.804.686	BNY Mellon	15/9/2023	(11.820)
USD	714.231	SGD	964.760	BNY Mellon	15/9/2023	143
Moins-value nette non réalisée						(11.677)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 24.164.389)						(151.090)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Finance	31,85
Matériaux de base	17,06
Biens de consommation non cyclique	16,73
Biens de consommation cyclique	11,26
Énergie	9,16
Valeurs industrielles	7,92
Communications	2,28
Technologie	2,27
Autres éléments de l'actif net	1,47
	100,00

Multi-Theme Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				374.281	iShares MSCI EM Consumer Growth UCITS ETF ⁻	11.434.285	6,96
						100.191.433	61,00
COMPARTIMENTS				Luxembourg			
Irlande				1.868.298	BlackRock Global Funds - Circular Economy Fund ^{oo}	24.740.745	15,06
1.466.365	iShares Ageing Population UCITS ETF ⁻	9.740.330	5,93	560.754	BlackRock Global Funds - FinTech Fund ^{oo}	6.619.644	4,03
254.835	iShares Agribusiness UCITS ETF ⁻	12.181.113	7,42	96.908	BlackRock Global Funds - Next Generation Technology Fund ^{oo}	1.663.622	1,01
1.152.486	iShares Automation & Robotics UCITS ETF ⁻	13.363.075	8,14	754.262	BlackRock Global Funds - Nutrition Fund ^{oo}	8.168.654	4,98
2.388.739	iShares Digital Security UCITS ETF ⁻	16.983.934	10,34	985.944	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund ^{oo}	22.501.911	13,70
867.569	iShares Electric Vehicles & Driving Technology UCITS ETF ⁻	6.602.200	4,02			63.694.576	38,78
347.480	iShares Global Clean Energy UCITS ETF ⁻	3.232.259	1,97	Total des Compartiments		163.886.009	99,78
296.612	iShares Global Infrastructure UCITS ETF ⁻	8.677.384	5,28	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
219.134	iShares Global Water UCITS ETF ⁻	13.108.596	7,98			163.886.009	99,78
661.448	iShares Healthcare Innovation UCITS ETF ⁻	4.868.257	2,96	Total du portefeuille			
						163.886.009	99,78
				Autres éléments de l'actif net		360.110	0,22
				Total de l'actif net (USD)		164.246.119	100,00

^{oo} Participation croisée d'un fonds à compartiments multiples et investissement dans le fonds d'une partie liée, pour de plus amples informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

Multi-Theme Equity Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	779.475	USD	856.957	Morgan Stanley	6/9/2023	(11.188)
USD	10.872.626	EUR	9.844.782	BNP Paribas	6/9/2023	190.543
Plus-value nette non réalisée						179.355
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	230.650	USD	253.014	BNY Mellon	15/9/2023	(2.637)
USD	15.743	EUR	14.432	BNY Mellon	15/9/2023	78
Moins-value nette non réalisée						(2.559)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	22.489.888	USD	28.610.446	BNY Mellon	15/9/2023	(99.707)
USD	1.781.016	GBP	1.401.895	BNY Mellon	15/9/2023	3.812
Moins-value nette non réalisée						(95.895)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 42.077.642)						80.901

Natural Resources Fund⁽⁷⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie				Royaume-Uni			
459.349	BHP	13.344.852	3,54	131.809	Anglo American	3.543.930	0,94
				2.806.322	BP	17.447.435	4,63
				950.893	Shell	29.164.641	7,74
						50.156.006	13,31
				États-Unis			
Bermudes				57.907	AGCO	7.589.291	2,02
73.585	Bunge	8.439.464	2,24	33.729	Albemarle	6.707.012	1,78
				93.388	Alcoa	2.815.648	0,75
Brésil				108.457	Archer-Daniels-Midland	8.712.351	2,31
1.049.335	Vale*	14.076.829	3,74	146.656	CF Industries	11.276.380	2,99
				53.883	Cheniere Energy	8.868.064	2,35
Canada				23.787	Chevron	3.824.950	1,02
95.979	Barrick Gold	1.571.176	0,42	116.304	ConocoPhillips	13.820.404	3,67
115.634	Cameco	4.302.741	1,14	62.063	Darling Ingredients*	3.909.969	1,04
127.778	Canadian Natural Resources	8.287.082	2,20	24.203	Deere	10.020.284	2,66
228.708	Cenovus Energy	4.571.260	1,21	39.609	EOG Resources	5.068.764	1,35
45.677	Filo	714.432	0,19	220.227	Exxon Mobil	24.409.961	6,48
327.828	First Quantum Minerals*	8.663.034	2,30	70.211	FMC	6.156.100	1,63
26.909	Franco-Nevada*	3.888.082	1,03	187.365	Freeport-McMoRan	7.550.809	2,01
140.865	Nutrien*	9.054.802	2,40	24.506	Hess	3.774.169	1,00
161.951	Stelco*	4.673.490	1,24	89.530	Newmont	3.571.352	0,95
259.277	Teck Resources	10.845.557	2,88	46.754	Packaging of America*	6.970.554	1,85
314.675	Wheaton Precious Metals	13.767.031	3,66			135.046.062	35,86
						372.594.462	98,92
				Total des actions ordinaires			
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
						372.594.462	98,92
Chili				Autres titres négociables			
35.491	Sociedad Quimica y Minera de Chile*	2.208.250	0,59	ACTIONS ORDINAIRES			
				Canada			
Curaçao				74.542	Filo Mining 4 Month Hold**	1.151.583	0,31
118.690	Schlumberger	6.983.719	1,85	Fédération de Russie			
				2.253.732	Gazprom**	235	0,00
Finlande				37.266	Polyus**	4	0,00
149.250	UPM-Kymmene*	5.146.074	1,37			239	0,00
						1.151.822	0,31
France						1.151.822	0,31
315.250	TotalEnergies	19.899.246	5,28			373.746.284	99,22
						2.924.784	0,78
						376.671.068	100,00
Irlande				Total des actions ordinaires			
39.789	Kerry	3.725.475	0,99	Total des autres valeurs mobilières			
146.219	Smurfit Kappa	6.191.704	1,64	Total du portefeuille			
				Autres éléments de l'actif net			
				Total de l'actif net (USD)			
Italie							
389.260	Eni	6.086.559	1,62				
Jersey							
3.172.115	Glencore	16.934.996	4,50				
Luxembourg							
235.401	ArcelorMittal	6.292.269	1,67				
Norvège							
1.384.295	Norsk Hydro	7.724.270	2,05				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Natural Resources Fund⁽⁷⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	31.075.490	USD	34.092.151	BNY Mellon	15/9/2023	(358.795)
USD	3.473.384	EUR	3.187.617	BNY Mellon	15/9/2023	13.145
Moins-value nette non réalisée						(345.650)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	253.494	USD	322.550	BNY Mellon	15/9/2023	(1.191)
USD	21.821	GBP	17.160	BNY Mellon	15/9/2023	66
Moins-value nette non réalisée						(1.125)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 37.516.893)						(346.775)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Énergie	43,28
Matériaux de base	42,83
Biens de consommation non cyclique	6,58
Valeurs industrielles	6,53
Autres éléments de l'actif net	0,78
	100,00

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Next Generation Health Care Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				1.991	908 Devices	15.032	0,08
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES				780	ACADIA Pharmaceuticals	21.068	0,11
Belgique				1.230	Align Technology	459.221	2,50
1.295	Galapagos	48.886	0,26	1.145	Allakos	3.366	0,02
3.910	Nyxoah	31.241	0,17	1.695	Alnylam Pharmaceuticals	338.153	1,84
3.005	UCB	269.819	1,47	1.765	Amgen	453.587	2,47
		349.946	1,90	470	Apellis Pharmaceuticals	19.707	0,11
Îles Vierges britanniques				955	Arcturus Therapeutics	29.796	0,16
642	Biohaven	12.063	0,07	1.500	Arcus Biosciences	30.285	0,16
Canada				657	Arrowhead Pharmaceuticals	17.956	0,10
3.607	Bausch + Lomb*	65.647	0,36	1.995	Arvinas	54.962	0,30
Îles Caïmans				1.455	Aura Biosciences	15.379	0,08
770	BeiGene*	162.355	0,88	5.580	Avantor	123.039	0,67
25.000	Kindstar Globalgene Technology	4.845	0,03	3.170	Baxter International	131.238	0,71
3.713	Legend Biotech	258.982	1,41	650	Becton Dickinson	182.845	1,00
2.747	MoonLake Immunotherapeutics	155.535	0,85	820	Biogen	218.522	1,19
		581.717	3,17	2.526	BioMarin Pharmaceutical	238.442	1,30
Danemark				1.314	Biomea Fusion	21.799	0,12
660	Bavarian Nordic	14.894	0,08	170	Bio-Rad Laboratories	67.874	0,37
253	Genmab	97.982	0,53	2.325	Bio-Techne	186.093	1,01
793	Genmab	30.721	0,17	7.635	Black Diamond Therapeutics	26.570	0,14
1.935	Novo Nordisk	359.987	1,96	2.830	Blueprint Medicines	140.311	0,76
		503.584	2,74	9.830	Boston Scientific	535.342	2,91
Allemagne				565	Bridgebio Pharma	17.153	0,09
2.038	Gerresheimer	263.123	1,43	1.586	Bruker	105.501	0,57
445	MorphoSys	13.605	0,07	2.865	Catalent	143.221	0,78
290	Sartorius	118.491	0,64	2.485	Cencora	441.659	2,40
		395.219	2,14	2.190	Cerevel Therapeutics	52.494	0,29
Irlande				850	CONMED	96.560	0,53
9.140	Alkermes	264.877	1,44	966	Cooper	362.260	1,97
623	Horizon Therapeutics	70.433	0,38	1.116	Dexcom	114.959	0,63
665	Prothena	36.170	0,20	11.495	Elanco Animal Health	143.802	0,78
1.445	STERIS	335.197	1,82	1.300	Eli Lilly	713.700	3,89
		706.677	3,84	974	Encompass Health	69.583	0,38
Jersey				2.005	Exact Sciences	166.997	0,91
1.784	Novocure	38.838	0,21	4.200	Exelixis	94.710	0,52
Pays-Bas				1.945	Frequency Therapeutics	914	0,01
1.053	Argenx*	530.681	2,89	3.465	Gilead Sciences	266.251	1,45
2.170	CureVac*	19.400	0,11	925	Glaukos	70.124	0,38
3.769	Merus*	82.202	0,45	1.785	Guardant Health	70.400	0,38
5.315	QIAGEN	244.277	1,33	1.475	Halozyne Therapeutics	63.263	0,34
		876.560	4,78	1.715	Hologic	130.083	0,71
Suisse				3.060	ImmunoGen	48.409	0,26
6.552	Alcon*	550.401	3,00	2.600	Incyte	168.428	0,92
420	CRISPR Therapeutics	21.017	0,11	420	Inspire Medical Systems	98.356	0,54
1.795	Sophia Genetics	4.434	0,02	1.773	Intuitive Surgical	567.644	3,09
895	Straumann*	136.295	0,74	4.350	Ionis Pharmaceuticals*	176.393	0,96
		712.147	3,87	1.415	Iovance Biotherapeutics	8.667	0,05
Royaume-Uni				1.230	IQVIA	277.992	1,51
12.095	Abcam	274.556	1,50	400	Karuna Therapeutics	74.044	0,40
36.133	ConvaTec	107.090	0,58	1.074	Keros Therapeutics	38.224	0,21
3.620	Haleon*	30.010	0,16	1.722	Kinnate Biopharma	3.995	0,02
2.795	Immunocore	156.380	0,85	1.610	MacroGenics	7.792	0,04
		568.036	3,09	2.125	Masimo	243.918	1,33
États-Unis				345	McKesson	144.590	0,79
1.655	10X Genomics	86.077	0,47	105	Mettler-Toledo International	128.585	0,70
835	4D Molecular Therapeutics	13.886	0,08	1.550	Mirati Therapeutics	57.668	0,31
				997	Monte Rosa Therapeutics	6.221	0,03
				1.350	Morphic*	75.398	0,41
				1.545	Neurocrine Biosciences	168.235	0,92
				2.173	Nuvalent*	100.219	0,55
				1.420	Omniceil	82.019	0,45
				3.640	Pacific Biosciences of California	41.278	0,22
				951	Penumbra	249.638	1,36
				1.132	Pliant Therapeutics	19.108	0,10
				2.105	PMV Pharmaceuticals	15.724	0,09
				3.264	Prime Medicine*	43.248	0,24
				3.645	Protagonist Therapeutics	72.754	0,40
				1.995	PTC Therapeutics	80.877	0,44

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Next Generation Health Care Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Produits de santé	35,72
Biotechnologie	33,73
Produits pharmaceutiques	20,07
Services de santé	2,70
Emballages et contenants	1,43
Électronique	1,34
Services commerciaux	0,27
Soins cosmétiques/personnels	0,16
Ingénierie et construction	0,08
Logiciels	0,02
Autres éléments de l'actif net	4,48
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Next Generation Technology Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Taiwan			
				2.137.000	Accton Technology	32.075.272	1,25
				282.000	ASPEED Technology	23.908.415	0,93
				2.668.000	Delta Electronics	28.986.771	1,13
				163.000	eMemory Technology	9.289.710	0,36
				586.191	Lotes	15.921.837	0,62
				4.256.000	Unimicron Technology	24.790.396	0,97
				8.111.000	Wistron	29.798.759	1,16
				391.000	Wiwynn	19.153.109	0,75
				1.249.000	Yageo	19.021.383	0,74
						202.945.652	7,91
ACTIONS ORDINAIRES				Royaume-Uni			
Australie				10.576.206	Alphawave IP	19.440.045	0,76
1.672.898	Altium	52.458.163	2,04	6.293.792	Informa*	58.934.693	2,30
6.448.747	SiteMinder	20.426.442	0,80	1.451.960	Sage	17.964.033	0,70
		72.884.605	2,84	1.778.315	Wise*	14.431.907	0,56
						110.770.678	4,32
Brésil				États-Unis			
1.988.035	TOTVS	11.419.382	0,44	606.758	Amkor Technology	17.049.900	0,66
				95.046	Aspen Technology	18.633.768	0,73
				55.554	Atlassian	11.423.569	0,45
				105.388	Axcelis Technologies*	20.076.414	0,78
				116.491	BILL*	13.533.924	0,53
				1.123.256	Coupang	21.173.376	0,82
				247.044	Entegris	25.045.321	0,98
				123.288	Expedia	13.401.406	0,52
				82.990	First Solar	15.651.084	0,61
				210.936	Fortinet	12.919.830	0,50
				528.118	Jabil*	61.393.718	2,39
				75.927	KLA	38.081.187	1,48
				745.977	Lattice Semiconductor	71.673.470	2,79
				1.234.714	Legalzoom.com	14.088.086	0,55
				106.391	Manhattan Associates	21.782.493	0,85
				645.338	Marvell Technology	37.745.820	1,47
				28.748	MercadoLibre	38.867.296	1,51
				128.753	MongoDB	49.277.636	1,92
				104.051	Monolithic Power Systems	54.206.409	2,11
				320.351	NVIDIA	159.275.314	6,21
				606.229	ON Semiconductor*	60.137.917	2,34
				201.319	Palo Alto Networks*	48.658.802	1,90
				614.329	Pinterest	17.195.069	0,67
				1.461.096	Pure Storage	50.700.031	1,98
				581.412	Rambus*	32.919.547	1,28
				298.097	Rapid7*	15.369.881	0,60
				183.254	Roku	14.911.378	0,58
				514.569	Samsara	14.073.462	0,55
				448.222	SentinelOne*	7.368.770	0,29
				256.852	Shift4 Payments*	14.684.229	0,57
				92.127	Skyworks Solutions	10.019.733	0,39
				1.023.974	Snap	10.500.853	0,41
				353.244	Squarespace	10.745.682	0,42
				63.967	Super Micro Computer*	17.356.166	0,68
				225.638	Synopsys	104.134.193	4,06
				299.301	Take-Two Interactive Software	42.650.393	1,66
				297.053	Tesla	76.410.943	2,98
				162.393	TransUnion	13.413.662	0,53
				597.193	Unity Software*	22.269.327	0,87
				628.099	Wolfspeed*	29.910.074	1,17
						1.328.730.133	51,79
Canada				Total des actions ordinaires			
169.446	Kinaxis	20.656.301	0,81			2.482.120.415	96,75
Îles Caïmans				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
288.000	Alchip Technologies	22.337.130	0,87			2.482.120.415	96,75
1.733.077	Credo Technology*	28.457.124	1,11				
2.817.821	Farfetch*	8.199.859	0,32				
785.164	Trip.com	31.061.088	1,21				
		90.055.201	3,51				
France							
272.314	SOITEC*	50.078.059	1,95				
Allemagne							
259.982	AIXTRON	9.917.449	0,39				
277.146	CTS Eventim	17.289.573	0,67				
197.068	Nemetschek*	13.628.121	0,53				
		40.835.143	1,59				
Japon							
931.800	Appier*	11.290.877	0,44				
57.000	Disco	11.210.463	0,44				
771.700	Freee*	16.051.236	0,62				
561.000	Fujimi*	12.935.379	0,51				
306.200	GMO Payment Gateway*	19.332.997	0,75				
447.100	Ibiden*	26.895.447	1,05				
188.000	Lasertec*	29.166.986	1,14				
448.500	M3*	8.909.856	0,35				
773.400	Nexon	15.647.390	0,61				
1.366.800	Nikon*	14.719.603	0,57				
		166.160.234	6,48				
Kazakhstan							
294.675	Kaspi.KZ JSC	30.646.200	1,19				
Luxembourg							
165.153	Spotify Technology	25.045.452	0,98				
Pays-Bas							
10.561	Adyen	8.927.011	0,35				
171.931	ASM International*	83.773.190	3,27				
434.069	BE Semiconductor Industries	50.579.073	1,97				
285.370	Wolters Kluwer	34.676.412	1,35				
		177.955.686	6,94				
Nouvelle-Zélande							
471.887	Xero*	38.238.765	1,49				
Corée du Sud							
136.174	NAVER	22.098.977	0,86				
80.731	Samsung SDI	37.502.428	1,46				
376.993	SK Hynix	34.740.115	1,36				
		94.341.520	3,68				
Espagne							
309.419	Amadeus IT*	21.357.404	0,83				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Next Generation Technology Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Autres titres négociables				18.800	SambaNova Systems**	1.492.156	0,06
ACTIONS ORDINAIRES				84.195	SambaNova Systems**	6.682.557	0,26
Inde				332.896	Snorkel AI**	3.132.551	0,12
				66.737	Snorkel AI**	627.995	0,02
385	Think & Learn Pvt**	290.876	0,01	1.088.252	SNYK**	12.504.016	0,49
363	Think & Learn Pvt**	274.254	0,01	168.509	SNYK**	1.936.169	0,08
		565.130	0,02	153.445	Trax**	4.092.378	0,16
Suède				56.120	Unqork**	455.694	0,02
10.483	Klarna Bank**	2.217.611	0,09	8.240	Unqork**	48.698	0,00
États-Unis				13.040	Unqork**	84.890	0,00
364.947	Astranis Space Technologies**	7.999.638	0,31	7.440	Unqork**	42.036	0,00
94.118	Automatic**	4.604.253	0,18	170.320	Unqork**	953.792	0,04
44.038	ByteDance**	7.648.953	0,30	20.400	Unqork**	115.668	0,01
27.939	Databricks**	1.492.222	0,06			71.534.851	2,79
57.237	Databricks**	3.057.028	0,12	Total des actions ordinaires		74.317.592	2,90
143.769	Databricks**	7.678.702	0,30	Total des autres valeurs mobilières		74.317.592	2,90
114.138	Datarobot**	699.666	0,02	Total du portefeuille		2.556.438.007	99,65
62.665	Datarobot**	313.952	0,01	Autres éléments de l'actif net		9.078.413	0,35
30.250	Farmer's Business Network**	737.495	0,03	Total de l'actif net (USD)		2.565.516.420	100,00
81.731	Rapyd Financial Network (2016)**	5.134.342	0,20				

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	6.069	USD	3.949	BNY Mellon	15/9/2023	(15)
USD	378	AUD	584	BNY Mellon	15/9/2023	(3)
Moins-value nette non réalisée						(18)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	5.364.071	USD	6.139.417	BNY Mellon	15/9/2023	(58.697)
USD	596.069	CHF	523.222	BNY Mellon	15/9/2023	2.947
Moins-value nette non réalisée						(55.750)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	19.088.252	USD	2.637.334	BNY Mellon	15/9/2023	(12.145)
USD	206.795	CNY	1.503.820	BNY Mellon	15/9/2023	(25)
Moins-value nette non réalisée						(12.170)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	442.957.550	USD	485.704.893	BNY Mellon	15/9/2023	(4.861.607)
USD	49.147.332	EUR	45.101.103	BNY Mellon	15/9/2023	188.938
Moins-value nette non réalisée						(4.672.669)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	47.634.701	USD	60.599.568	BNY Mellon	15/9/2023	(212.409)
USD	6.237.379	GBP	4.915.978	BNY Mellon	15/9/2023	5.330
Moins-value nette non réalisée						(207.079)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	37.190.054	USD	4.763.584	BNY Mellon	15/9/2023	(19.200)
USD	1.111.236	HKD	8.693.170	BNY Mellon	15/9/2023	2.239
Moins-value nette non réalisée						(16.961)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Next Generation Technology Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	6.734	USD	4.063	BNY Mellon	15/9/2023	(58)
USD	384	NZD	646	BNY Mellon	15/9/2023	–
Moins-value nette non réalisée						(58)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	1.514	SGD	2.050	BNY Mellon	5/9/2023	(2)
SGD	56.675.138	USD	42.085.367	BNY Mellon	15/9/2023	(136.000)
USD	4.584.448	SGD	6.203.110	BNY Mellon	15/9/2023	(6.913)
Moins-value nette non réalisée						(142.915)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 658.001.496)						(5.107.620)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Semi-conducteurs	35,10
Logiciels	21,14
Internet	10,55
Électronique	5,77
Ordinateurs	5,67
Services commerciaux	4,58
Télécommunications	3,82
Média	3,65
Constructeurs automobiles	2,98
Composants et équipements électriques	1,13
Systèmes logiciels	0,89
Logiciels d'application	0,87
Divertissement	0,67
Sources d'énergie alternatives	0,61
Manufactures diverses	0,57
Matériaux de construction	0,51
Logiciels et services	0,31
Assurance	0,20
Biens de consommation durable et habillement	0,18
Commerces de détail	0,16
Acquisitions à des fins déterminées	0,14
Traitement de données et services externalisés	0,09
Transporteurs alternatifs	0,03
Services éducatifs	0,02
Matériel technologique et Semi-conducteurs	0,01
Autres éléments de l'actif net	0,35
	100,00

Nutrition Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES ET WARRANTS							
Bermudes				Suisse			
94.385	Bunge*	10.825.016	4,00	3.741	Barry Callebaut*	6.561.084	2,43
				40.249	DSM-Firmenich*	3.722.257	1,38
				802	Givaudan*	2.694.191	0,99
				90.987	Nestle	10.996.210	4,07
				58.209	SGS	5.285.681	1,95
						29.259.423	10,82
Canada				Royaume-Uni			
175.268	Growth International	7.508.945	2,78	375.840	Compass	9.584.705	3,55
393.003	Jamieson Wellness	7.582.009	2,80	873.109	Tate & Lyle	7.869.324	2,91
343.521	Maple Leaf Foods*	7.544.037	2,79			17.454.029	6,46
94.075	Nutrien	6.047.141	2,24	États-Unis			
909.501	SunOpta*	4.074.564	1,51	50.033	AGCO	6.557.325	2,42
		32.756.696	12,12	106.465	Archer-Daniels-Midland	8.552.333	3,16
Îles Caïmans				30.634	Avery Dennison*	5.789.826	2,14
2.532.000	China Mengniu Dairy	8.522.886	3,15	69.011	CF Industries	5.306.256	1,97
Chine				67.571	Crown	6.280.049	2,32
1.537.640	Pony Testing International	4.565.143	1,69	43.195	Darling Ingredients*	2.721.285	1,01
France				20.936	Deere	8.667.713	3,21
7.705	Robertet	7.130.656	2,64	95.932	FMC	8.411.317	3,11
Allemagne				410.142	Graphic Packaging*	9.187.181	3,40
93.455	HelloFresh*	2.997.194	1,11	250.154	Grocery Outlet	7.727.257	2,86
57.795	Symrise	6.061.008	2,24	77.077	John Bean Technologies*	8.478.470	3,14
		9.058.202	3,35	19.227	Union Pacific	4.278.200	1,58
				55.853	Zoetis*	10.780.188	3,99
						92.737.400	34,31
1.389.318	Marel	5.004.349	1,85	Total des actions ordinaires et warrants		260.384.973	96,33
Irlande				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
97.910	Kerry	9.167.389	3,39			260.384.973	96,33
193.434	Smurfit Kappa	8.191.042	3,03				
		17.358.431	6,42	Autres titres négociables			
Île de Man				ACTIONS ORDINAIRES ET WARRANTS			
40.452.126	Agronomics	4.933.053	1,83	Îles Caïmans			
5.687.215	Agronomics (Wts 8/12/2023)	78	0,00	720.000	China Forestry**	1	0,00
		4.933.131	1,83	Île de Man			
Japon				4.747.573	Agronomics (Wts 1/6/2024)**	-	0,00
237.100	FP	4.542.302	1,68	Total des actions ordinaires et warrants		1	0,00
Pays-Bas				Total des autres valeurs mobilières			
261.944	Koninklijke Ahold Delhaize*	8.621.052	3,19			1	0,00
Norvège				Total du portefeuille		260.384.974	96,33
5.184.570	Hofseth BioCare	1.494.677	0,55	Autres éléments de l'actif net			
125.603	Salmar*	6.121.580	2,27			9.931.529	3,67
		7.616.257	2,82	Total de l'actif net (USD)		270.316.503	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Nutrition Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	7.617.475	USD	8.356.620	BNY Mellon	15/9/2023	(87.628)
USD	408.531	EUR	373.860	BNY Mellon	15/9/2023	2.695
Moins-value nette non réalisée						(84.933)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	1.364.249	USD	1.735.723	BNY Mellon	15/9/2023	(6.246)
USD	84.771	GBP	66.630	BNY Mellon	15/9/2023	303
Moins-value nette non réalisée						(5.943)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	562.244	USD	3.946	BNY Mellon	15/9/2023	(92)
USD	184	JPY	26.595	BNY Mellon	15/9/2023	2
Moins-value nette non réalisée						(90)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	6.546.775	USD	1.611.556	BNY Mellon	15/9/2023	(23.160)
USD	100.812	PLN	412.734	BNY Mellon	15/9/2023	673
Moins-value nette non réalisée						(22.487)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	2.307	SGD	3.123	BNY Mellon	5/9/2023	(4)
SGD	12.477.105	USD	9.268.985	BNY Mellon	15/9/2023	(33.778)
USD	532.176	SGD	720.124	BNY Mellon	15/9/2023	(836)
Moins-value nette non réalisée						(34.618)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 21.943.318)						(148.071)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Producteurs alimentaires	29,68
Produits chimiques	14,57
Diversification des machines	10,26
Agriculture	8,17
Emballages et contenants	7,40
Produits pharmaceutiques	7,34
Services commerciaux	3,64
Services alimentaires	3,55
Manufactures diverses	3,14
Produits forestiers et papier	3,03
Produits ménagers	2,14
Sociétés d'investissement	1,83
Transports	1,58
Autres éléments de l'actif net	3,67
	100,00

Sustainable Asian Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 300.000	Huarong Finance II 5% 19/11/2025	259.500	0,23
COMPARTIMENTS				USD 200.000	Huarong Finance II 5,5% 16/1/2025	183.038	0,16
Luxembourg				HKD 2.000.000	Link CB 1,6% 3/4/2024	247.674	0,22
241.804	BlackRock Global Funds - China Onshore Bond Fund*	3.384.154	3,01	USD 200.000	New Metro Global 4,625% 15/10/2025	59.507	0,05
Total des Compartiments		3.384.154	3,01	USD 200.000	Ocean Laurel 2,375% 20/10/2025	183.910	0,16
OBLIGATIONS				USD 200.000	Oriental Capital 7% 28/9/2025	189.488	0,17
Australie				USD 400.000	Peak RE Bvi 5,35% 28/10/2025*	335.116	0,30
USD 200.000	Australia & New Zealand Banking 4,4% 19/5/2026	191.990	0,17	USD 200.000	RKPF Overseas 2019 A 6% 4/9/2025	93.000	0,08
USD 300.000	Commonwealth Bank of Australia 2,688% 11/3/2031	235.249	0,21	USD 200.000	SF Investment 2,875% 20/2/2030	171.644	0,15
USD 300.000	Commonwealth Bank of Australia 3,784% 14/3/2032	250.010	0,22	USD 400.000	SF Investment 2021 3,125% 17/11/2031	336.614	0,30
USD 250.000	National Australia Bank 6,429% 12/1/2033	253.051	0,23	USD 350.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance II 5,95% 4/2/2027	31.500	0,03
USD 200.000	SGSP Australia Assets 3,25% 29/7/2026	187.695	0,17	USD 200.000	Sino-Ocean Land Treasure IV 2,7% 13/1/2025	24.065	0,02
		1.117.995	1,00	USD 330.806	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033	322.665	0,29
Bermudes				USD 200.000	Sunny Express Enterprises 3,125% 23/4/2030	178.029	0,16
USD 250.000	Luye Pharma 6,25% 6/7/2028	224.584	0,20	EUR 200.000	Talent Yield Euro 1% 24/9/2025	200.143	0,18
USD 400.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4,85% 14/10/2038*	351.954	0,31	USD 200.000	TCL Technology Investments 1,875% 14/7/2025	184.785	0,16
		576.538	0,51	USD 900.000	TSMC Global 1,375% 28/9/2030	704.390	0,63
Îles Vierges britanniques				USD 200.000	TSMC Global 1,75% 23/4/2028	172.888	0,15
USD 200.000	Celestial Miles 5,75% 31/1/2024	187.983	0,17	USD 400.000	Vertex Capital Investment 4,75% 3/4/2024	393.556	0,35
EUR 310.000	Cheung Kong Infrastructure Finance BVI 1% 12/12/2024	319.698	0,29	USD 200.000	Wharf REIC Finance BVI 2,375% 7/5/2025	188.627	0,17
USD 200.000	China Cinda 2020 I Management 5,75% 7/2/2027*	196.794	0,18			9.429.713	8,39
USD 200.000	China Cinda Finance 2015 I 4,25% 23/4/2025	192.838	0,17	Îles Caïmans			
USD 200.000	China Cinda Finance 2017 I 4,4% 9/3/2027	188.681	0,17	USD 300.000	Agile 6,05% 13/10/2025	34.500	0,03
USD 200.000	China Cinda Finance 2017 I 4,75% 8/2/2028	188.221	0,17	USD 300.000	Alibaba 2,7% 9/2/2041	192.137	0,17
USD 300.000	China Great Wall International V 2,875% 23/11/2026	251.877	0,22	USD 400.000	Baidu 1,625% 23/2/2027	352.910	0,32
USD 200.000	Chouzhou International Investment 4% 18/2/2025	193.460	0,17	USD 500.000	Baidu 2,375% 23/8/2031	397.513	0,35
USD 400.000	CMHI Finance BVI 5% 6/8/2028	398.546	0,36	USD 200.000	Baidu 4,375% 29/3/2028	191.692	0,17
USD 200.000	Coastal Emerald 4,3% 1/8/2024	195.087	0,17	USD 800.000	CCBL Cayman 1 1,6% 15/9/2026	712.948	0,64
USD 400.000	Elect Global Investments 4,1% 3/6/2025	325.326	0,29	USD 200.000	CCBL Cayman 1 1,8% 22/7/2026	180.049	0,16
USD 250.000	Fortune Star BVI 5% 18/5/2026	165.650	0,15	USD 1.050.000	CDBL Funding 1 3,5% 24/10/2027	984.291	0,88
USD 400.000	HKT Capital No 2 3,625% 2/4/2025	387.222	0,34	USD 200.000	CDBL Funding 1 4,25% 2/12/2024	195.870	0,17
USD 200.000	HKT Capital No 6 3% 18/1/2032	165.791	0,15	USD 250.000	China Resources Land 3,75% 9/12/2024	238.735	0,21
USD 200.000	Huafa 2019 I 4,25% 3/7/2024	194.969	0,17	EUR 150.000	CK Hutchison Europe Finance 18 2% 13/4/2030	142.577	0,13
USD 200.000	Huantaihu International Investment 7,3% 16/2/2026	199.000	0,18	EUR 250.000	CK Hutchison Europe Finance 21 0,75% 2/11/2029	221.071	0,20
USD 400.000	Huarong Finance 2017 4,75% 27/4/2027	314.438	0,28	USD 200.000	CK Hutchison International 20 2,5% 8/5/2030	168.699	0,15
USD 200.000	Huarong Finance 2019 2,125% 30/9/2023	198.919	0,18	USD 400.000	CK Hutchison International 20 3,375% 8/5/2050*	286.320	0,25
USD 200.000	Huarong Finance 2019 3,25% 13/11/2024	182.982	0,16	USD 900.000	CK Hutchison International 23 4,75% 21/4/2028*	877.347	0,78
USD 300.000	Huarong Finance 2019 6,895% 24/2/2025	272.868	0,24	USD 850.000	CK Hutchison International 23 4,875% 21/4/2033	819.485	0,73
USD 300.000	Huarong Finance II 4,625% 3/6/2026	249.224	0,22	USD 200.000	Country Garden 5,125% 17/1/2025	20.100	0,02

∞ Participation croisée d'un fonds à compartiments multiples et investissement dans le fonds d'une partie liée, pour de plus amples informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Asian Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 600.000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	597.560	0,53	USD 500.000	Bank of East Asia 5,825% 21/10/2025	386.173	0,34
USD 500.000	ENN Energy 4,625% 17/5/2027	487.052	0,43	USD 250.000	China Taiping Insurance 6,4% 9/3/2028	255.606	0,23
USD 400.000	ESR 1,5% 30/9/2025	396.500	0,35	USD 250.000	Chong Hing Bank 5,5% 3/8/2025	235.978	0,21
USD 200.000	Fantasia 9,25% 28/7/2023***	10.000	0,01	USD 450.000	CMB International Leasing Management 1,75% 16/9/2026*	400.138	0,36
USD 500.000	FWD 5,75% 9/7/2024	488.937	0,44	USD 600.000	Dah Sing Bank 3% 2/11/2031	522.996	0,47
USD 200.000	Gaci First Investment 4,875% 14/2/2035	189.024	0,17	USD 200.000	Far East Horizon 2,625% 3/3/2024	187.846	0,17
USD 400.000	Goodman HK Finance 4,375% 19/6/2024	393.668	0,35	USD 250.000	GLP China 2,95% 29/3/2026	143.058	0,13
USD 400.000	Haidilao International 2,15% 14/1/2026	362.000	0,32	USD 200.000	Hongkong International Qingdao 4% 8/10/2024	194.986	0,17
USD 200.000	Hutchison Whampoa International 03/33 7,45% 24/11/2033	229.974	0,21	USD 400.000	ICBCIL Finance 1,75% 25/8/2025*	370.292	0,33
USD 400.000	ICD Funding 3,223% 28/4/2026*	372.524	0,33	USD 1.400.000	ICBCIL Finance 2,25% 2/11/2026	1.269.065	1,13
USD 200.000	Lamar Funding 3,958% 7/5/2025	191.689	0,17	USD 800.000	Lenovo 3,421% 2/11/2030*	667.052	0,60
USD 200.000	Longfor 3,95% 16/9/2029	118.631	0,11	USD 200.000	Pingan Real Estate Capital 2,75% 29/7/2024	160.000	0,14
USD 300.000	OmGrid Funding 5,196% 16/5/2027	287.155	0,26	CNH 1.000.000	Swire Properties MTN Financing 3,3% 25/7/2025	137.697	0,12
USD 200.000	PCGI Intermediate 4,75% 28/10/2024	188.250	0,17	USD 200.000	Vanke Real Estate Hong Kong 3,975% 9/11/2027	153.346	0,14
USD 200.000	QNB Finance 1,625% 22/9/2025	184.289	0,16			7.179.220	6,41
USD 200.000	Shui On Development 5,5% 29/6/2026	91.000	0,08		Inde		
USD 200.000	Sunac China 6,5% 9/7/2023***	22.000	0,02	USD 400.000	Axis Bank 4,1% 8/9/2026*	348.862	0,31
USD 200.000	Sunac China 7,95% 11/10/2023***	22.000	0,02	USD 400.000	GMR Hyderabad International Airport 4,75% 2/2/2026	381.846	0,34
		10.665.997	9,50	USD 400.000	HDFC Bank 3,7% 25/8/2026*	347.600	0,31
				USD 504.000	JSW Hydro Energy 4,125% 18/5/2031*	425.386	0,38
	Chine			USD 200.000	Muthoot Finance 4,4% 2/9/2023	199.980	0,18
USD 570.000	China Life Insurance Overseas 5,35% 15/8/2033	562.777	0,50	EUR 400.000	Power Finance 1,841% 21/9/2028	365.692	0,32
USD 200.000	Gansu Provincial Highway Aviation Tourism Investment 3,25% 3/11/2023	197.792	0,18	USD 600.000	Power Finance 3,75% 6/12/2027	553.749	0,49
USD 200.000	Guangxi Financial Investment 3,6% 18/11/2023	197.622	0,18	USD 700.000	Power Finance 3,9% 16/9/2029	625.408	0,56
USD 600.000	Guoren Property & Casualty Insurance 3,35% 1/6/2026	516.819	0,46	USD 250.000	Power Finance 6,15% 6/12/2028	253.748	0,23
USD 200.000	Henan Railway Construction & Investment 2,2% 26/1/2025	188.436	0,17	USD 300.000	REC 2,25% 1/9/2026	271.225	0,24
USD 200.000	Shaoxing Shangyu State-owned Capital Investment Operation 2,95% 16/3/2024	195.289	0,17	USD 1.000.000	REC 3,875% 7/7/2027	930.445	0,83
USD 200.000	Taizhou Urban Construction and Investment Development 2,05% 2/9/2024	190.276	0,17	USD 200.000	REC 5,625% 11/4/2028	197.587	0,18
USD 200.000	Tianjin Rail Transit Urban Development 6,2% 25/9/2023	199.500	0,18	USD 800.000	Reliance Industries 2,875% 12/1/2032*	657.372	0,58
USD 200.000	Wuhan Urban Construction 2,25% 9/7/2024	192.977	0,17	USD 750.000	Reliance Industries 3,625% 12/1/2052*	512.872	0,46
USD 600.000	ZhongAn Online P&C Insurance 3,125% 16/7/2025	526.668	0,47	USD 500.000	Shriram Finance 4,4% 13/3/2024	492.137	0,44
		2.968.156	2,65	USD 800.000	Summit Digitel Infrastructure 2,875% 12/8/2031*	630.120	0,56
				USD 200.000	UltraTech Cement 2,8% 16/2/2031	161.893	0,15
						7.355.922	6,56
	France				Indonésie		
SGD 500.000	Credit Agricole 5,25% 7/9/2033	369.880	0,33	USD 500.000	Bank Negara Indonesia Persero 3,75% 30/3/2026	465.662	0,41
	Hong Kong			USD 600.000	Bank Tabungan Negara Persero 4,2% 23/1/2025	570.120	0,51
USD 200.000	AIA 3,6% 9/4/2029	184.937	0,17	USD 1.250.000	Freeport Indonesia 5,315% 14/4/2032*	1.163.963	1,04
USD 600.000	Airport Authority 2,1% 8/3/2026	547.188	0,49	USD 200.000	Hutama Karya Persero 3,75% 11/5/2030	180.941	0,16
USD 650.000	Airport Authority 2,4% 8/3/2028	565.038	0,50	USD 200.000	Hyundai Motor Manufacturing Indonesia 1,75% 6/5/2026	179.337	0,16
USD 400.000	Airport Authority 4,75% 12/1/2028	398.184	0,35	USD 627.000	Indonesia Government International Bond 3,55% 31/3/2032	558.708	0,50
USD 400.000	Airport Authority 4,875% 12/1/2033	399.640	0,36	USD 1.800.000	Indonesia Government International Bond 4,65% 20/9/2032	1.741.158	1,55

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Asian Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 800.000	Indonesia Government International Bond 4,85% 11/1/2033*	784.948	0,70	Luxembourg			
USD 900.000	Indonesia Government International Bond 5,45% 20/9/2052	889.393	0,79	USD 550.000	Greensaif Pipelines Bidco 6,129% 23/2/2038*	552.805	0,49
USD 600.000	Indonesia Government International Bond 5,65% 11/1/2053	613.965	0,55	Malaisie			
USD 450.000	Indonesia Government International Bond 6,625% 17/2/2037	502.263	0,45	USD 200.000	Axiata SPV2 4,357% 24/3/2026	194.310	0,17
USD 450.000	Indonesia Government International Bond 8,5% 12/10/2035	573.534	0,51	USD 200.000	CIMB Bank 6,323% 9/10/2024	200.226	0,18
USD 200.000	Pertamina Geothermal Energy 5,15% 27/4/2028	197.750	0,18	USD 450.000	Dua Capital 2,78% 11/5/2031	380.254	0,34
USD 200.000	Pertamina Persero 3,1% 21/1/2030	173.914	0,15	USD 500.000	Export-Import Bank of Malaysia 1,831% 26/11/2026	446.498	0,40
USD 200.000	Pertamina Persero 4,175% 21/1/2050	152.724	0,13	1.221.288 1,09			
USD 200.000	Pertamina Persero 4,7% 30/7/2049	164.970	0,15	Maurice			
USD 200.000	Pertamina Persero 5,625% 20/5/2043	186.894	0,17	USD 200.000	Azure Power Solar Energy Pvt 5,65% 24/12/2024	175.820	0,16
USD 400.000	Pertamina Persero 6% 3/5/2042	388.636	0,35	USD 200.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	179.648	0,16
USD 400.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3,55% 9/6/2051	297.224	0,26	USD 186.000	Clean Renewable Power Mauritius 4,25% 25/3/2027	162.341	0,14
USD 500.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3,8% 23/6/2050*	386.118	0,34	USD 450.000	Greenko Solar Mauritius 5,55% 29/1/2025*	436.426	0,39
USD 525.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,7% 6/6/2032	511.219	0,46	USD 475.000	Greenko Solar Mauritius 5,95% 29/7/2026	447.675	0,40
USD 1.050.000	Sarana Multi Infrastruktur Perusahaan Perseroan Persero 2,05% 11/5/2026	924.000	0,82	USD 400.000	Greenko Wind Projects Mauritius 5,5% 6/4/2025	385.696	0,34
USD 200.000	Tower Bersama Infrastructure 2,75% 20/1/2026	184.186	0,17	USD 250.000	India Airport Infra 6,25% 25/10/2025*	244.924	0,22
USD 200.000	Tower Bersama Infrastructure 4,25% 21/1/2025	194.332	0,17	USD 750.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024	738.750	0,66
11.985.959 10,68				USD 750.000	India Green Power 4% 22/2/2027*	664.380	0,59
Japon				USD 455.000	Network i2i 3,975% 3/3/2026*	417.688	0,37
USD 200.000	Asahi Mutual Life Insurance 6,5% 5/9/2023	200.000	0,18	USD 600.000	Network i2i 5,65% 15/1/2025	584.049	0,52
USD 215.000	Asahi Mutual Life Insurance 6,9% 26/1/2028	217.913	0,20	USD 200.000	UPL 4,5% 8/3/2028	176.017	0,16
USD 450.000	Marubeni 1,577% 17/9/2026	399.987	0,35	4.613.414 4,11			
USD 300.000	Mizuho Financial 4,353% 20/10/2025	287.730	0,26	Mongolie			
USD 200.000	Nissan Motor 3,522% 17/9/2025	189.217	0,17	USD 200.000	Mongolia Government International Bond 5,125% 7/4/2026	185.743	0,16
USD 200.000	Nissan Motor 4,345% 17/9/2027	182.977	0,16	USD 200.000	Mongolia Government International Bond 8,65% 19/1/2028	200.813	0,18
USD 200.000	Nissan Motor 4,81% 17/9/2030	176.572	0,16	386.556 0,34			
USD 600.000	Renesas Electronics 1,543% 26/11/2024	564.895	0,51	Pays-Bas			
USD 800.000	Renesas Electronics 2,17% 25/11/2026	710.278	0,63	USD 376.000	Greenko Dutch 3,85% 29/3/2026	340.363	0,30
EUR 100.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	104.944	0,09	USD 200.000	Royal Capital 5% 5/2/2026	194.630	0,17
EUR 100.000	SoftBank 3,125% 19/9/2025	103.137	0,09	EUR 550.000	Syngenta Finance 3,375% 16/4/2026	579.156	0,52
USD 350.000	Sumitomo Mitsui Financial 6,184% 13/7/2043	352.205	0,31	1.114.149 0,99			
USD 200.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank 2,8% 10/3/2027	183.302	0,16	Philippines			
3.673.157 3,27				USD 400.000	Development Bank of the Philippines 2,375% 11/3/2031	322.094	0,29
Jersey				USD 600.000	Globe Telecom 4,2% 2/8/2026	560.367	0,50
USD 709.680	Galaxy Pipeline Assets Bidco 2,16% 31/3/2034	597.004	0,53	USD 200.000	Philippine Government International Bond 3,7% 1/3/2041	160.904	0,14
				USD 200.000	Philippine Government International Bond 3,95% 20/1/2040	168.983	0,15
				USD 700.000	Philippine Government International Bond 5% 17/7/2033*	700.864	0,62
				USD 200.000	Philippine Government International Bond 5,5% 17/1/2048	201.581	0,18
				USD 200.000	Philippine Government International Bond 5,609% 13/4/2033	208.637	0,19

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Asian Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	
USD 1.100.000	Minor International 2,7% 19/4/2026	1.004.245	0,89	USD 750.000	Standard Chartered 6,296% 6/7/2034	746.960	0,67	
USD 200.000	Muang Thai Life Assurance 3,552% 27/1/2037	177.720	0,16	USD 400.000	Standard Chartered 6,301% 9/1/2029	403.342	0,36	
USD 400.000	Thaioil Treasury Center 2,5% 18/6/2030*	320.768	0,28			5.347.998	4,76	
USD 250.000	Thaioil Treasury Center 3,5% 17/10/2049	154.361	0,14	États-Unis				
USD 450.000	Thaioil Treasury Center 3,75% 18/6/2050	289.098	0,26	USD 200.000	DAE Funding 1,625% 15/2/2024	195.159	0,18	
		4.264.277	3,80	USD 225.000	Hanwha Energy USA 4,125% 5/7/2025	217.972	0,19	
Émirats arabes unis				USD 700.000	Hanwha Q Cells Americas 5% 27/7/2028	692.897	0,62	
USD 300.000	Masdar Abu Dhabi Future Energy 4,875% 25/7/2033	293.149	0,26	USD 200.000	HCL America 1,375% 10/3/2026	180.736	0,16	
USD 250.000	MDGH GMTN RSC 5,084% 22/5/2053	236.798	0,21	USD 350.000	Hyundai Capital America 6,375% 8/4/2030	358.890	0,32	
		529.947	0,47	USD 200.000	Nissan Motor Acceptance 2,75% 9/3/2028	168.658	0,15	
Royaume-Uni				USD 200.000	SK Battery America 1,625% 26/1/2024	195.953	0,17	
USD 200.000	HSBC 3,973% 22/5/2030	180.003	0,16	USD 200.000	TSMC Arizona 2,5% 25/10/2031	165.617	0,15	
USD 250.000	HSBC 6,332% 9/3/2044	252.578	0,22	USD 400.000	Wipro IT Services 1,5% 23/6/2026*	358.698	0,32	
USD 350.000	HSBC 6,375% 30/3/2025	337.846	0,30			2.534.580	2,26	
USD 400.000	HSBC 6,547% 20/6/2034	391.566	0,35	Vietnam				
USD 350.000	HSBC 6,905% 14/8/2027	351.562	0,31	USD 250.000	BIM Land JSC 7,375% 7/5/2026	177.924	0,16	
EUR 250.000	Jaguar Land Rover Automotive 5,875% 15/11/2024	272.801	0,24	Total des obligations			104.286.521	92,92
EUR 200.000	Jaguar Land Rover Automotive 6,875% 15/11/2026*	219.708	0,20	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			107.670.675	95,93
USD 869.000	Standard Chartered 2,678% 29/6/2032	684.153	0,61	Total du portefeuille			107.670.675	95,94
USD 200.000	Standard Chartered 2,819% 30/1/2026	190.379	0,17	Autres éléments de l'actif net			4.560.871	4,06
USD 1.100.000	Standard Chartered 4,644% 1/4/2031	1.016.246	0,90	Total de l'actif net (USD)			112.231.546	100,00
USD 300.000	Standard Chartered 6,17% 9/1/2027	300.854	0,27					

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
CNH	2.700.000	USD	369.148	Citigroup	20/9/2023	2.276
CNH	1.380.000	USD	189.363	HSBC Bank	20/9/2023	475
EUR	100.000	USD	108.332	BNP Paribas	20/9/2023	246
IDR	8.100.000.000	USD	541.263	HSBC Bank	17/10/2023	(9.778)
IDR	8.622.290.000	USD	565.211	BNP Paribas	17/10/2023	545
MYR	9.082.000	USD	1.995.606	Goldman Sachs	17/10/2023	(32.434)
USD	117.601	KRW	150.000.000	Bank of America	13/12/2023	3.613
USD	271.007	CNH	1.800.000	BNP Paribas	21/2/2024	20.693
USD	132.893	CNH	900.000	Citigroup	21/2/2024	7.736
USD	2.071.375	MYR	9.082.000	Goldman Sachs	17/10/2023	108.202
USD	835.955	IDR	12.422.290.000	HSBC Bank	17/10/2023	20.861
USD	292.280	IDR	4.300.000.000	Citigroup	17/10/2023	10.134
USD	384.531	HKD	3.000.000	Goldman Sachs	20/9/2023	1.725
USD	186.858	SGD	250.000	Goldman Sachs	20/9/2023	1.773
USD	2.406.594	EUR	2.188.800	Goldman Sachs	20/9/2023	30.026
USD	2.439.092	CNH	17.500.000	BNP Paribas	20/9/2023	31.719
USD	1.107.190	CNH	8.000.000	HSBC Bank	20/9/2023	6.676
USD	271.519	EUR	250.000	Citigroup	20/9/2023	73
USD	199.038	CNH	1.450.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(430)
Plus-value nette non réalisée						204.131

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Asian Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	98.873	USD	108.489	BNY Mellon	15/9/2023	(1.159)
USD	2.106	EUR	1.928	BNY Mellon	15/9/2023	12
Moins-value nette non réalisée						(1.147)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	42.371	USD	3.965	BNY Mellon	15/9/2023	(79)
USD	77	SEK	842	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(79)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 14.295.539)						202.905

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
30	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	3.326.719	26.484
(18)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	2.087.719	(18.562)
32	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	4.143.000	45.567
44	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	8.961.562	23.375
1	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	106.805	633
Total				18.625.805	77.497

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR (800.000)	Fund provides default protection on HSBC; and receives Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	2.015	8.945
CDS	USD (500.000)	Fund provides default protection on Philippines; and receives Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	4.312	6.191
CDS	USD (1.300.000)	Fund provides default protection on Indonesia; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	2.187	10.299
CDS	USD (800.000)	Fund provides default protection on ITRAXX.AUST.39.V1; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	2.314	7.631
CDS	USD (3.800.000)	Fund provides default protection on ITRX ASIAXJ IG S39; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	158	(46.597)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 7.268.280)					10.986	(13.531)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
6	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.700	15/9/2023	(6.292)	1.071
8	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.800	15/9/2023	(7.176)	918
15	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 6.800	17/11/2023	1.182	14.248
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 15.092)						(12.286)	16.237

Sustainable Asian Bond Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(14)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.500	15/9/2023	2.934	(89)
(15)	Call	Hang Seng China Enterprises Index	Exchange Traded	HKD 7.600	17/11/2023	262	(2.773)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.863)						3.196	(2.862)

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
USD 2.700.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.ASIA.XJ.IG.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 1% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	(5.083)	8.417
EUR 2.000.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.XO.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	(14.589)	1.374
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.356.001)				(19.672)	9.791

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
USD (3.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.ASIA.XJ.IG.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 1% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	4.962	(588)
EUR (2.000.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.XO.39.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Deutsche Bank	20/9/2023	7.583	(650)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 1.202.166)				12.545	(1.238)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				CNY 290.000	China Government Bond 3,72% 12/4/2051	45.754	0,11
						906.825	2,12
OBLIGATIONS				Colombie			
	Argentine			USD 200.000	Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031	154.250	0,36
USD 292.712	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2035*	87.824	0,21	USD 200.000	Colombia Government International Bond 3,25% 22/4/2032	150.153	0,35
USD 385.508	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2046	116.009	0,27	USD 196.000	Colombia Government International Bond 7,375% 18/9/2037	190.211	0,44
USD 863.794	Argentine Republic Government International Bond 4,25% 9/1/2038	304.535	0,71	USD 200.000	Colombia Government International Bond 7,5% 2/2/2034	198.415	0,46
		508.368	1,19	COP 933.400.000	Colombian TES 6% 28/4/2028	194.981	0,46
	Autriche			COP 1.246.800.000	Colombian TES 6,25% 9/7/2036	212.075	0,50
USD 355.000	Klabn Austria 3,2% 12/1/2031*	284.526	0,66	COP 833.200.000	Colombian TES 7% 26/3/2031	169.050	0,40
	Bahreïn			COP 1.187.900.000	Colombian TES 7% 30/6/2032	233.653	0,55
USD 200.000	Bahrain Government International Bond 7,75% 18/4/2035*	205.308	0,48	COP 1.151.700.000	Colombian TES 7,25% 18/10/2034	220.181	0,51
	Bénin			COP 492.200.000	Colombian TES 7,5% 26/8/2026	112.941	0,26
EUR 304.000	Benin Government International Bond 4,95% 22/1/2035*	232.915	0,54	COP 1.148.100.000	Colombian TES 7,75% 18/9/2030	247.612	0,58
	Brésil			COP 1.218.500.000	Colombian TES 9,25% 28/5/2042	257.669	0,60
BRL 4.648.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	936.449	2,19			2.341.191	5,47
BRL 3.650.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	735.090	1,72	USD 200.000	Costa Rica Government International Bond 7,158% 12/3/2045*	201.623	0,47
BRL 3.261.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2029	644.516	1,50				
BRL 817.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2031	160.980	0,38		Côte d'Ivoire		
		2.477.035	5,79	EUR 140.000	Ivory Coast Government International Bond 6,625% 22/3/2048	106.499	0,25
	Îles Caïmans			EUR 388.000	Ivory Coast Government International Bond 6,875% 17/10/2040*	317.721	0,74
USD 385.000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	380.757	0,89			424.220	0,99
	Chili				République tchèque		
CLP 505.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,5% 1/3/2026	573.797	1,34	CZK 5.140.000	Czech Republic Government Bond 0% 12/12/2024*	216.515	0,51
CLP 155.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5% 1/10/2028	180.234	0,42	CZK 8.680.000	Czech Republic Government Bond 0,05% 29/11/2029*	300.816	0,70
USD 354.000	Chile Government International Bond 2,55% 27/1/2032*	297.760	0,70	CZK 3.690.000	Czech Republic Government Bond 0,25% 10/2/2027	143.674	0,34
USD 505.000	Chile Government International Bond 3,1% 7/5/2041*	367.375	0,86	CZK 6.060.000	Czech Republic Government Bond 0,95% 15/5/2030*	220.013	0,51
USD 200.000	Chile Government International Bond 4,34% 7/3/2042*	172.006	0,40	CZK 12.690.000	Czech Republic Government Bond 1% 26/6/2026	517.672	1,21
		1.591.172	3,72	CZK 5.890.000	Czech Republic Government Bond 1,2% 13/3/2031	213.283	0,50
	Chine			CZK 11.310.000	Czech Republic Government Bond 1,25% 14/2/2025	481.298	1,12
CNY 3.150.000	China Government Bond 2,85% 4/6/2027	439.963	1,03	CZK 5.920.000	Czech Republic Government Bond 2% 13/10/2033	217.169	0,51
CNY 690.000	China Government Bond 3,03% 11/3/2026	96.852	0,22	CZK 6.840.000	Czech Republic Government Bond 2,5% 25/8/2028*	281.822	0,66
CNY 450.000	China Government Bond 3,25% 22/11/2028	64.400	0,15	CZK 5.690.000	Czech Republic Government Bond 2,75% 23/7/2029	234.845	0,55
CNY 1.800.000	China Government Bond 3,27% 19/11/2030	259.856	0,61	CZK 5.870.000	Czech Republic Government Bond 5,7% 25/5/2024	264.949	0,62
						3.092.056	7,23
					République dominicaine		
				USD 169.000	Dominican Republic International Bond 5,3% 21/1/2041	132.651	0,31

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 127.000	Dominican Republic International Bond 6,875% 29/1/2026	128.028	0,30	USD 350.000	Hungary Government International Bond 5,5% 16/6/2034	332.778	0,78
USD 191.000	Dominican Republic International Bond 7,45% 30/4/2044	184.264	0,43	USD 217.000	MVM Energetika Zrt 7,5% 9/6/2028*	221.069	0,52
DOP 9.350.000	Dominican Republic International Bond 13,625% 3/2/2033	201.168	0,47			2.572.272	6,01
		646.111	1,51		Indonésie		
				USD 200.000	Indonesia Government International Bond 4,75% 18/7/2047*	184.156	0,43
	Équateur			IDR 1.331.000.000	Indonesia Treasury Bond 5,5% 15/4/2026	86.039	0,20
USD 501.632	Ecuador Government International Bond 3,5% 31/7/2035	188.385	0,44	IDR 2.598.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,5% 15/2/2031	171.693	0,40
USD 249.026	Ecuador Government International Bond 6% 31/7/2030*	123.414	0,29	IDR 7.326.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/9/2030	498.101	1,16
		311.799	0,73	IDR 840.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,5% 15/6/2035	59.401	0,14
				IDR 1.709.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,5% 15/5/2038	121.021	0,28
	Égypte			IDR 1.365.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029	97.827	0,23
USD 291.000	Egypt Government International Bond 6,875% 30/4/2040	150.291	0,35	IDR 9.626.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/3/2034	720.844	1,69
USD 431.000	Egypt Government International Bond 7,903% 21/2/2048	220.439	0,52			1.939.082	4,53
USD 308.000	Egypt Government International Bond 8,5% 31/1/2047	164.178	0,38				
		534.908	1,25		Jamaïque		
				USD 200.000	Jamaica Government International Bond 7,875% 28/7/2045	227.820	0,53
	El Salvador				Jordanie		
USD 158.000	El Salvador Government International Bond 7,65% 15/6/2035*	112.104	0,26	USD 200.000	Jordan Government International Bond 7,375% 10/10/2047	175.448	0,41
USD 21.000	El Salvador Government International Bond 8,25% 10/4/2032	16.121	0,04				
USD 200.000	El Salvador Government International Bond 9,5% 15/7/2052*	149.300	0,35		Kenya		
		277.525	0,65	USD 200.000	Republic of Kenya Government International Bond 8,25% 28/2/2048	149.794	0,35
	Gabon				Luxembourg		
USD 359.000	Gabon Government International Bond 6,625% 6/2/2031	261.835	0,61	USD 180.000	Millicom International Cellular 6,25% 25/3/2029	164.912	0,39
	Ghana				Malaisie		
USD 256.000	Ghana Government International Bond 6,375% 11/2/2027	111.987	0,26	MYR 2.858.000	Malaysia Government Bond 3,828% 5/7/2034	609.240	1,42
USD 553.000	Ghana Government International Bond 8,875% 7/5/2042	231.591	0,54	MYR 382.000	Malaysia Government Bond 4,065% 15/6/2050	79.326	0,19
		343.578	0,80	MYR 900.000	Malaysia Government Investment Issue 4,369% 31/10/2028	200.683	0,47
						889.249	2,08
	Guatemala				Mexique		
USD 216.000	Guatemala Government Bond 5,375% 24/4/2032	206.055	0,48	MXN 6.108.200	Mexican Bonos 7,5% 3/6/2027	340.032	0,79
				MXN 10.459.300	Mexican Bonos 7,75% 29/5/2031	568.989	1,33
	Hongrie			MXN 20.433.900	Mexican Bonos 7,75% 23/11/2034	1.090.004	2,55
HUF 104.410.000	Hungary Government Bond 1% 26/11/2025	254.905	0,59	MXN 11.912.600	Mexican Bonos 8% 7/12/2023	705.673	1,65
HUF 93.150.000	Hungary Government Bond 3% 26/6/2024*	252.902	0,59	USD 200.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	165.614	0,39
HUF 173.030.000	Hungary Government Bond 4% 28/4/2051	311.152	0,73	USD 267.000	Mexico Government International Bond 4,15% 28/3/2027*	262.006	0,61
HUF 74.510.000	Hungary Government Bond 5,5% 24/6/2025	200.852	0,47	USD 200.000	Mexico Government International Bond 4,4% 12/2/2052*	153.662	0,36
HUF 218.480.000	Hungary Government Bond 6% 24/11/2023	617.064	1,44				
EUR 348.000	Hungary Government International Bond 5% 22/2/2027*	381.550	0,89				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 200.000	Mexico Government International Bond 4,5% 31/1/2050	158.962	0,37	USD 552.000	Qatar Qatar Government International Bond 4,4% 16/4/2050*	485.506	1,13
USD 290.000	Mexico Government International Bond 5,75% 12/10/2110	253.425	0,59		Roumanie		
		3.698.367	8,64	RON 655.000	Romania Government Bond 3,25% 24/6/2026	132.781	0,31
	Mongolie			RON 870.000	Romania Government Bond 4,15% 26/1/2028*	175.228	0,41
USD 200.000	Mongolia Government International Bond 4,45% 7/7/2031	155.463	0,36	RON 790.000	Romania Government Bond 6,7% 25/2/2032*	173.163	0,40
	Maroc			EUR 211.000	Romanian Government International Bond 2,75% 26/2/2026*	218.440	0,51
USD 230.000	Morocco Government International Bond 4% 15/12/2050	150.760	0,35	USD 142.000	Romanian Government International Bond 3% 14/2/2031*	117.716	0,28
	Oman			USD 242.000	Romanian Government International Bond 4% 14/2/2051	166.397	0,39
USD 400.000	Oman Government International Bond 6,5% 8/3/2047*	376.506	0,88	USD 200.000	Romanian Government International Bond 6,125% 22/1/2044*	189.190	0,44
USD 396.000	Oman Government International Bond 7,375% 28/10/2032	433.147	1,01			1.172.915	2,74
		809.653	1,89		Arabie Saoudite		
	Panama			USD 274.000	Saudi Government International Bond 3,45% 2/2/2061	182.450	0,42
USD 200.000	Panama Government International Bond 4,5% 15/5/2047	153.320	0,36	USD 710.000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053	632.166	1,48
USD 200.000	Panama Government International Bond 4,5% 16/4/2050	149.629	0,35			814.616	1,90
USD 200.000	Panama Government International Bond 6,4% 14/2/2035	205.382	0,48		Sénégal		
USD 308.000	Panama Government International Bond 9,375% 1/4/2029	364.798	0,85	EUR 231.000	Senegal Government International Bond 5,375% 8/6/2037	167.976	0,39
		873.129	2,04	USD 200.000	Senegal Government International Bond 6,25% 23/5/2033	164.062	0,39
	Pérou					332.038	0,78
PEN 1.180.000	Peru Government Bond 6,15% 12/8/2032	310.215	0,72		Serbie		
PEN 1.035.000	Peru Government Bond 8,2% 12/8/2026	297.412	0,70	USD 200.000	Serbia International Bond 2,125% 1/12/2030	152.796	0,36
USD 129.000	Peruvian Government International Bond 5,625% 18/11/2050*	128.398	0,30		Afrique du Sud		
		736.025	1,72	ZAR 10.604.960	Republic of South Africa Government Bond 7% 28/2/2031*	458.405	1,07
	Philippines			ZAR 11.681.356	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	557.840	1,30
USD 315.000	Philippine Government International Bond 4,2% 29/3/2047	264.294	0,62	ZAR 4.267.989	Republic of South Africa Government Bond 8,25% 31/3/2032*	192.991	0,45
	Pologne			ZAR 6.087.964	Republic of South Africa Government Bond 8,5% 31/1/2037	248.533	0,58
PLN 1.135.000	Republic of Poland Government Bond 2,25% 25/10/2024	265.955	0,62	ZAR 4.696.566	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048*	180.885	0,42
PLN 1.191.000	Republic of Poland Government Bond 2,5% 25/7/2027	261.044	0,61	ZAR 6.594.143	Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035*	289.436	0,68
PLN 1.066.000	Republic of Poland Government Bond 2,75% 25/4/2028	231.992	0,54	ZAR 2.825.329	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	115.205	0,27
PLN 1.321.000	Republic of Poland Government Bond 2,75% 25/10/2029*	277.607	0,65	ZAR 12.000.257	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026	668.251	1,56
PLN 837.000	Republic of Poland Government Bond 3,25% 25/7/2025	195.607	0,46				
PLN 996.000	Republic of Poland Government Bond 3,75% 25/5/2027	229.201	0,53				
PLN 851.000	Republic of Poland Government Bond 6% 25/10/2033	212.969	0,50				
		1.674.375	3,91				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 434.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 22/6/2030	396.166	0,93	USD 490.000	Émirats arabes unis UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 4,951% 7/7/2052	465.152	1,09
USD 200.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 20/4/2032	177.478	0,42		États-Unis		
		3.285.190	7,68	USD 126.400	United States Treasury Bill 0% 24/11/2023	124.833	0,29
	Sri Lanka			USD 148.500	United States Treasury Note/ Bond 1,375% 30/9/2023	148.019	0,35
USD 226.000	Sri Lanka Government International Bond 6,75% 18/4/2028	102.481	0,24	USD 1.000.100	United States Treasury Note/ Bond 1,625% 31/10/2023	993.818	2,32
USD 200.000	Sri Lanka Government International Bond 6,85% 3/11/2025	94.565	0,22	USD 1.358.200	United States Treasury Note/ Bond 2,5% 30/4/2024	1.332.618	3,11
		197.046	0,46	USD 365.000	United States Treasury Note/ Bond 2,5% 31/5/2024	357.328	0,84
	Suède					2.956.616	6,91
EUR 60.822	East Renewable 13,5% 1/1/2025	8.249	0,02		Uruguay		
	Trinité-et-Tobago			UYU 3.557.000	Uruguay Government International Bond 8,5% 15/3/2028	91.799	0,21
USD 216.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 4,5% 4/8/2026	209.412	0,49		Zambie		
	Turquie			USD 225.000	Zambia Government International Bond 8,5% 14/4/2024	119.492	0,28
USD 259.000	Turkey Government International Bond 5,25% 13/3/2030	221.941	0,52		Total des obligations	41.278.220	96,45
USD 263.000	Turkey Government International Bond 9,375% 19/1/2033	276.501	0,65		Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	41.278.220	96,45
		498.442	1,17		Autres titres négociables		
	Ukraine				OBLIGATIONS		
USD 485.000	Ukraine Government International Bond 7,375% 25/9/2034	129.131	0,30		Ukraine		
USD 200.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2027	57.670	0,13	UAH 4.659.000	Ukraine Government International Bond 16% 24/5/2023**,**	126.373	0,29
USD 200.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2028	57.800	0,14		Total des obligations	126.373	0,29
USD 1.165.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/8/2041	535.900	1,25		Total des autres valeurs mobilières	126.373	0,29
		780.501	1,82		Total du portefeuille	41.404.593	96,75
					Autres éléments de l'actif net	1.392.717	3,25
					Total de l'actif net (USD)	42.797.310	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
BRL	1.717.097	USD	354.023	Goldman Sachs	5/9/2023	(5.561)
BRL	320.147	USD	65.303	UBS	5/9/2023	(333)
BRL	1.087.359	USD	222.377	Citigroup	5/9/2023	(1.712)
BRL	3.124.603	USD	634.852	Goldman Sachs	3/10/2023	(3.644)
CAD	1.032.626	USD	776.346	JP Morgan	13/9/2023	(12.948)
CHF	730.491	USD	820.417	Toronto-Dominion	13/9/2023	7.480
CLP	72.264.755	USD	89.564	JP Morgan	13/9/2023	(5.076)
CLP	176.717.973	USD	215.589	Bank of America	13/9/2023	(8.980)
CLP	184.542.446	USD	221.947	Goldman Sachs	13/9/2023	(6.191)
CLP	184.179.000	USD	215.213	BNP Paribas	13/9/2023	119

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
CNH	958.891	USD	133.297	Morgan Stanley	13/9/2023	(1.436)
CNY	2.172.646	USD	301.467	BNY Mellon	13/9/2023	(2.444)
COP	1.433.890.000	USD	358.297	BNY Mellon	13/9/2023	(10.151)
CZK	4.570.000	USD	210.936	Citigroup	13/9/2023	(4.902)
CZK	320.000	USD	14.308	Barclays	13/9/2023	119
EUR	297.096	USD	327.077	Deutsche Bank	13/9/2023	(4.604)
EUR	396.128	USD	438.074	Royal Bank of Canada	13/9/2023	(8.110)
EUR	791.825	USD	870.866	JP Morgan	13/9/2023	(11.405)
EUR	399.639	USD	446.531	Morgan Stanley	13/9/2023	(12.756)
EUR	199.310	USD	220.301	Société Générale	13/9/2023	(3.967)
EUR	10.000	USD	10.998	RBS	13/9/2023	(144)
EUR	393.677	USD	433.016	BNP Paribas	13/9/2023	(5.712)
EUR	10.000	USD	10.896	Nomura	13/9/2023	(41)
GBP	777.777	USD	993.138	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(7.149)
GBP	341.654	USD	440.183	JP Morgan	13/9/2023	(7.067)
GBP	10.000	USD	12.597	HSBC Bank	13/9/2023	81
HKD	3.256.433	USD	417.995	Goldman Sachs	15/9/2023	(2.569)
HKD	3.265.054	USD	418.849	HSBC Bank	15/9/2023	(2.323)
HUF	152.745.233	USD	433.690	Goldman Sachs	13/9/2023	1.264
IDR	8.965.599.746	USD	594.312	HSBC Bank	13/9/2023	(5.693)
IDR	3.297.544.807	USD	217.125	BNP Paribas	13/9/2023	(631)
IDR	3.351.430.375	USD	223.072	Deutsche Bank	13/9/2023	(3.040)
JPY	155.972.810	USD	1.095.182	Morgan Stanley	13/9/2023	(26.468)
JPY	1.770.000	USD	12.548	Deutsche Bank	13/9/2023	(420)
JPY	1.420.000	USD	10.346	Royal Bank of Canada	13/9/2023	(616)
JPY	31.128.676	USD	223.954	JP Morgan	13/9/2023	(10.663)
JPY	2.720.000	USD	19.173	State Street	13/9/2023	(535)
JPY	30.695.185	USD	215.497	Toronto-Dominion	13/9/2023	(5.176)
KRW	282.688.741	USD	217.585	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(3.692)
MXN	7.573.837	USD	439.298	JP Morgan	13/9/2023	12.557
MXN	110.000	USD	6.527	Royal Bank of Canada	13/9/2023	35
MYR	6.232.210	USD	1.341.414	Goldman Sachs	13/9/2023	2.604
NZD	701.430	USD	434.376	JP Morgan	13/9/2023	(17.192)
NZD	350.715	USD	216.562	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(7.970)
NZD	351.088	USD	221.018	Deutsche Bank	13/9/2023	(12.204)
NZD	351.088	USD	220.419	Barclays	13/9/2023	(11.605)
NZD	357.441	USD	212.281	RBS	13/9/2023	312
PEN	80.000	USD	21.482	Citigroup	13/9/2023	204
PLN	2.164.519	USD	525.025	Bank of America	13/9/2023	200
PLN	40.000	USD	10.043	Morgan Stanley	13/9/2023	(337)
RON	1.876.067	USD	411.843	Goldman Sachs	13/9/2023	58
THB	97.867.873	USD	2.813.104	Bank of America	13/9/2023	(15.780)
THB	7.603.227	USD	221.153	UBS	13/9/2023	(3.832)
USD	837.075	HKD	6.521.487	Citigroup	15/9/2023	5.122
USD	202.943	PHP	11.282.621	Standard Chartered Bank	13/9/2023	3.720
USD	2.470.598	EUR	2.261.895	Morgan Stanley	13/9/2023	15.497
USD	499.551	HUF	177.765.126	Toronto-Dominion	13/9/2023	(6.649)
USD	219.946	AUD	329.062	HSBC Bank	13/9/2023	6.725
USD	418.788	JPY	59.633.477	Morgan Stanley	13/9/2023	10.184
USD	339.250	MXN	5.856.810	Bank of America	13/9/2023	(10.167)
USD	1.600.966	CZK	35.116.747	HSBC Bank	13/9/2023	17.763
USD	38.532	TWD	1.202.785	HSBC Bank	13/9/2023	761
USD	1.313.200	COP	5.488.242.640	Goldman Sachs	13/9/2023	(19.341)
USD	1.064.504	ZAR	20.231.944	Morgan Stanley	13/9/2023	(11.383)
USD	778.159	CAD	1.032.626	HSBC Bank	13/9/2023	14.761

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	126.958	PEN	465.109	JP Morgan	13/9/2023	874
USD	439.654	JPY	62.242.418	JP Morgan	13/9/2023	13.173
USD	111.020	HUF	38.828.607	Morgan Stanley	13/9/2023	453
USD	222.673	IDR	3.333.831.397	JP Morgan	13/9/2023	3.797
USD	223.044	HUF	77.657.214	BNP Paribas	13/9/2023	1.909
USD	234.334	EUR	208.389	Royal Bank of Canada	13/9/2023	8.144
USD	223.095	PHP	12.153.718	JP Morgan	13/9/2023	8.490
USD	228.304	GBP	173.912	JP Morgan	13/9/2023	7.835
USD	442.199	NZD	717.429	Morgan Stanley	13/9/2023	15.499
USD	674.079	CLP	549.879.394	Morgan Stanley	13/9/2023	31.192
USD	209.749	PLN	834.164	Morgan Stanley	13/9/2023	7.338
USD	884.456	EUR	798.076	JP Morgan	13/9/2023	18.210
USD	584.900	MXN	9.892.912	Morgan Stanley	13/9/2023	(5.311)
USD	259.573	JPY	35.975.889	Barclays	13/9/2023	13.069
USD	404.912	CHF	348.812	State Street	13/9/2023	9.588
USD	498.664	THB	17.117.831	UBS	13/9/2023	9.391
USD	221.650	GBP	172.822	Morgan Stanley	13/9/2023	2.564
USD	189.579	EUR	170.000	Deutsche Bank	13/9/2023	5.058
USD	332.168	IDR	5.021.048.699	Barclays	13/9/2023	2.521
USD	558.124	GBP	439.747	BNP Paribas	13/9/2023	656
USD	216.380	MXN	3.724.213	State Street	13/9/2023	(5.807)
USD	328.629	CNH	2.367.911	JP Morgan	13/9/2023	3.007
USD	113.366	COP	453.522.337	Bank of America	13/9/2023	3.252
USD	433.352	GBP	342.432	Royal Bank of Canada	13/9/2023	(750)
USD	111.817	COP	453.522.337	BNP Paribas	13/9/2023	1.702
USD	434.107	NZD	727.610	Goldman Sachs	13/9/2023	1.352
USD	217.656	CHF	190.035	Standard Chartered Bank	13/9/2023	2.281
USD	217.285	PHP	12.322.220	BNP Paribas	13/9/2023	(295)
USD	431.522	ZAR	8.139.475	UBS	13/9/2023	(1.316)
USD	584.707	ZAR	11.117.814	Nomura	13/9/2023	(6.512)
USD	10.816	EUR	10.000	RBS	13/9/2023	(38)
USD	214.627	KRW	282.734.197	JP Morgan	13/9/2023	699
USD	12.594	GBP	10.000	State Street	13/9/2023	(83)
USD	637.660	BRL	3.124.603	Goldman Sachs	5/9/2023	3.562
USD	452.781	JPY	66.023.811	ANZ	13/9/2023	391
ZAR	90.000	USD	5.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(214)
ZAR	5.031.501	USD	264.719	State Street	13/9/2023	2.844
ZAR	8.094.341	USD	432.463	Barclays	13/9/2023	(2.025)
ZAR	5.022.905	USD	265.925	Goldman Sachs	13/9/2023	1.181
ZAR	4.191.501	USD	221.256	HSBC Bank	13/9/2023	1.638
Moins-value nette non réalisée						(43.734)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	4.378	USD	5.013	BNY Mellon	15/9/2023	(49)
USD	125	CHF	110	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(49)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	8.941.683	USD	9.810.997	BNY Mellon	15/9/2023	(104.538)
USD	538.403	EUR	493.526	BNY Mellon	15/9/2023	2.669
Moins-value nette non réalisée						(101.869)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 52.327.206)						(145.652)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(5)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	721.488	2.658
1	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	144.797	(2.192)
(1)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	1.005.440	6.295
19	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	2.106.922	10.631
1	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	129.469	1.305
1	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	120.845	406
15	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	1.602.070	5.781
Total				5.831.031	24.884

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 913.785	Fund receives default protection on Korea International Bond; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(5.645)	(26.614)
CDS	USD 122.858	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(443)	13.285
CDS	USD 1.188.900	Fund receives default protection on CDX.EM.39; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(26.757)	48.623
CDS	EUR 315.400	Fund receives default protection on ITRAXX.XO.39.V1; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	(11.139)	(14.133)
CDS	USD 413.900	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(22.690)	44.756
CDS	USD 70.000	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(5.627)	7.569
CDS	USD 336.055	Fund receives default protection on Korea International Bond; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(1.911)	(9.788)
CDS	USD 700.114	Fund receives default protection on Korea International Bond; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(4.008)	(20.391)
CDS	USD 280.046	Fund receives default protection on Korea International Bond; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(1.603)	(8.156)
CDS	USD 140.000	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(13.207)	15.138
CDS	USD 130.000	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(8.481)	14.057
CDS	USD 240.000	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(533)	25.952
CDS	USD 384.800	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(16.890)	10.339
CDS	USD 920.800	Fund receives default protection on ITRX ASIAXJ IG S39; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(3.033)	11.291
IRS	BRL 6.343.950	Fund receives Fixed 10,57%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	(2.073)	(2.073)
IRS	MXN 22.000.000	Fund receives Fixed 9,79%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	7/8/2025	(8.587)	(8.587)
IRS	CLP 1.010.000.000	Fund receives Floating CLP Sinacofi Chile Interbank Rate 1 Day; and pays Fixed 6%	Bank of America	11/8/2025	4.824	4.824
IRS	MXN 11.478.323	Fund receives Fixed 6,12%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	7/4/2028	(73.805)	(73.805)
IRS	GBP 379.477	Fund receives Fixed 4,486%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	24/5/2028	(7.046)	(6.973)
IRS	ZAR 4.273.997	Fund receives Fixed 9%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Bank of America	20/9/2028	7.069	7.069
IRS	HUF 46.628.460	Fund receives Floating HUF BUBOR 6 Month; and pays Fixed 7,71%	Bank of America	20/9/2033	(9.001)	(9.001)
IRS	MYR 4.695.832	Fund receives Fixed 2,06%; and pays Floating MYR KLIB3M 3 Month	Goldman Sachs	22/5/2025	(26.134)	(26.134)
IRS	MYR 1.120.384	Fund receives Fixed 2,19%; and pays Floating MYR KLIB3M 3 Month	Goldman Sachs	22/5/2030	(23.161)	(23.161)
IRS	BRL 6.840.895	Fund receives Fixed 11,985%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2025	17.428	17.428
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 13.628.640)					(242.453)	(8.485)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
3.900.000	Put	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1,07	29/11/2023	23.629	28.584
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 1.249.742)						23.629	28.584

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.190.000	Colombia Government International Bond 6,125% 18/1/2041	984.136	0,46	USD 1.791.739	Ecuador Government International Bond 6% 31/7/2030	887.959	0,41
USD 1.396.000	Colombia Government International Bond 7,5% 2/2/2034	1.384.937	0,64			3.114.242	1,44
		8.712.125	4,03		Égypte		
	Costa Rica			USD 1.909.000	Egypt Government International Bond 5,25% 6/10/2025*	1.486.405	0,69
USD 998.000	Costa Rica Government International Bond 4,375% 30/4/2025*	975.171	0,45	USD 1.839.000	Egypt Government International Bond 7,3% 30/9/2033	1.019.256	0,47
USD 849.000	Costa Rica Government International Bond 5,625% 30/4/2043	739.802	0,34	USD 875.000	Egypt Government International Bond 7,5% 16/2/2061	443.568	0,20
USD 322.000	Costa Rica Government International Bond 6,125% 19/2/2031	321.890	0,15	USD 1.030.000	Egypt Government International Bond 7,6% 1/3/2029	664.654	0,31
USD 469.000	Costa Rica Government International Bond 7% 4/4/2044*	466.317	0,22	USD 1.272.000	Egypt Government International Bond 7,625% 29/5/2032	732.971	0,34
USD 562.000	Costa Rica Government International Bond 7,158% 12/3/2045	566.561	0,26	USD 756.000	Egypt Government International Bond 8,7% 1/3/2049	402.041	0,19
USD 776.000	Instituto Costarricense de Electricidad 6,375% 15/5/2043	651.661	0,30	USD 385.000	Egypt Government International Bond 8,875% 29/5/2050	207.192	0,09
		3.721.402	1,72			4.956.087	2,29
	Côte d'Ivoire				El Salvador		
EUR 1.303.000	Ivory Coast Government International Bond 4,875% 30/1/2032	1.093.633	0,51	USD 1.333.000	El Salvador Government International Bond 6,375% 18/1/2027	1.046.652	0,49
USD 286.307	Ivory Coast Government International Bond 5,75% 31/12/2032	260.567	0,12	USD 584.000	El Salvador Government International Bond 7,65% 15/6/2035	414.360	0,19
USD 337.000	Ivory Coast Government International Bond 6,125% 15/6/2033*	288.982	0,13	USD 501.000	El Salvador Government International Bond 8,625% 28/2/2029	386.456	0,18
		1.643.182	0,76			1.847.468	0,86
	République dominicaine				Gabon		
USD 1.569.000	Dominican Republic International Bond 4,5% 30/1/2030	1.372.028	0,64	USD 400.000	Gabon Government International Bond 6,625% 6/2/2031	291.738	0,13
USD 2.253.000	Dominican Republic International Bond 4,875% 23/9/2032	1.911.310	0,88	USD 200.000	Gabon Government International Bond 6,95% 16/6/2025	168.240	0,08
USD 850.000	Dominican Republic International Bond 5,3% 21/1/2041	667.178	0,31			459.978	0,21
USD 1.309.000	Dominican Republic International Bond 6% 19/7/2028*	1.267.773	0,59		Géorgie		
USD 638.000	Dominican Republic International Bond 6% 22/2/2033*	588.692	0,27	USD 2.100.000	Georgian Railway JSC 4% 17/6/2028	1.824.144	0,84
USD 260.000	Dominican Republic International Bond 6,5% 15/2/2048	222.770	0,10		Ghana		
USD 910.000	Dominican Republic International Bond 7,05% 3/2/2031*	904.208	0,42	USD 1.820.000	Ghana Government International Bond 6,375% 11/2/2027	796.159	0,37
		6.933.959	3,21	USD 775.000	Ghana Government International Bond 7,875% 26/3/2027	342.376	0,16
	Équateur			USD 1.005.000	Ghana Government International Bond 7,875% 11/2/2035	448.557	0,21
USD 1.740.521	Ecuador Government International Bond 2,5% 31/7/2040	582.752	0,27	USD 1.046.000	Ghana Government International Bond 8,125% 18/1/2026	482.044	0,22
USD 4.376.388	Ecuador Government International Bond 3,5% 31/7/2035	1.643.531	0,76	USD 1.110.000	Ghana Government International Bond 8,125% 26/3/2032	484.504	0,22
				USD 1.370.000	Ghana Government International Bond 8,625% 7/4/2034	605.382	0,28
				USD 492.000	Ghana Government International Bond 8,95% 26/3/2051	211.560	0,10
						3.370.582	1,56

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
	Guatemala						
USD 690.000	Guatemala Government Bond 4,375% 5/6/2027	651.157	0,30	USD 240.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,4% 6/6/2027	234.893	0,11
USD 340.000	Guatemala Government Bond 4,5% 3/5/2026*	327.177	0,15			10.614.740	4,91
USD 1.094.000	Guatemala Government Bond 5,375% 24/4/2032	1.043.632	0,48		International		
USD 250.000	Guatemala Government Bond 6,125% 1/6/2050	228.415	0,11	EUR 1.413.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 2,75% 22/1/2033	1.122.238	0,52
		2.250.381	1,04		Jamaïque		
	Hongrie			USD 590.000	Jamaica Government International Bond 6,75% 28/4/2028	610.269	0,28
USD 3.404.000	Hungary Government International Bond 2,125% 22/9/2031	2.627.020	1,22	USD 215.000	Jamaica Government International Bond 7,875% 28/7/2045	244.907	0,11
USD 900.000	Hungary Government International Bond 3,125% 21/9/2051	545.773	0,25	USD 547.000	Jamaica Government International Bond 8% 15/3/2039	644.856	0,30
USD 1.768.000	Hungary Government International Bond 5,25% 16/6/2029	1.730.730	0,80			1.500.032	0,69
USD 1.887.000	Hungary Government International Bond 6,125% 22/5/2028	1.916.598	0,89		Jordanie		
USD 690.000	Hungary Government International Bond 7,625% 29/3/2041	763.268	0,35	USD 438.000	Jordan Government International Bond 5,75% 31/1/2027	428.189	0,20
USD 920.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 6,125% 4/12/2027	916.095	0,43	USD 1.998.000	Jordan Government International Bond 5,85% 7/7/2030	1.848.440	0,85
USD 690.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6,5% 29/6/2028	695.347	0,32	USD 557.000	Jordan Government International Bond 7,375% 10/10/2047	488.622	0,23
USD 2.260.000	MVM Energetika Zrt 7,5% 9/6/2028	2.302.375	1,07			2.765.251	1,28
		11.497.206	5,33		Kazakhstan		
	Indonésie			USD 830.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 5,75% 12/5/2025	831.569	0,38
EUR 2.602.000	Indonesia Government International Bond 1,3% 23/3/2034	2.049.730	0,95	USD 296.000	Kazakhstan Government International Bond 4,875% 14/10/2044	265.188	0,12
USD 471.000	Indonesia Government International Bond 3,55% 31/3/2032*	419.699	0,19			1.096.757	0,50
EUR 1.050.000	Indonesia Government International Bond 3,75% 14/6/2028	1.123.022	0,52		Kenya		
USD 520.000	Indonesia Government International Bond 3,85% 18/7/2027	498.204	0,23	USD 255.000	Republic of Kenya Government International Bond 6,875% 24/6/2024	242.302	0,11
USD 695.000	Indonesia Government International Bond 4,125% 15/1/2025*	685.423	0,32	USD 600.000	Republic of Kenya Government International Bond 7% 22/5/2027	533.820	0,25
USD 1.037.000	Indonesia Government International Bond 4,35% 11/1/2048	889.549	0,41	USD 498.000	Republic of Kenya Government International Bond 8% 22/5/2032*	413.962	0,19
USD 2.205.000	Indonesia Government International Bond 4,55% 11/1/2028	2.161.308	1,00	USD 810.000	Republic of Kenya Government International Bond 8,25% 28/2/2048	606.666	0,28
USD 300.000	Indonesia Government International Bond 4,75% 18/7/2047*	276.234	0,13			1.796.750	0,83
USD 500.000	Indonesia Government International Bond 4,85% 11/1/2033*	490.592	0,22		Maurice		
USD 1.457.000	Indonesia Government International Bond 5,25% 17/1/2042*	1.446.444	0,67	USD 520.000	Greenko Wind Projects Mauritius 5,5% 6/4/2025	501.405	0,23
USD 346.000	Indonesia Government International Bond 5,25% 8/1/2047	339.642	0,16		Mexique		
				EUR 4.139.000	Mexico Government International Bond 2,25% 12/8/2036	3.265.062	1,51
				USD 1.124.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	930.751	0,43
				USD 759.000	Mexico Government International Bond 3,5% 12/2/2034	631.350	0,29

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 296.000	Mexico Government International Bond 4,4% 12/2/2052	227.420	0,11	USD 1.695.000	Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030	1.475.099	0,68
USD 1.490.000	Mexico Government International Bond 4,5% 22/4/2029	1.439.258	0,67	USD 2.857.000	Panama Government International Bond 3,875% 17/3/2028	2.689.823	1,25
USD 240.000	Mexico Government International Bond 4,6% 23/1/2046	194.382	0,09	USD 1.429.000	Panama Government International Bond 4,3% 29/4/2053	1.025.400	0,48
USD 915.000	Mexico Government International Bond 4,75% 27/4/2032*	868.440	0,40	USD 460.000	Panama Government International Bond 4,5% 15/5/2047*	352.636	0,16
USD 210.000	Mexico Government International Bond 4,75% 8/3/2044	176.575	0,08	USD 450.000	Panama Government International Bond 4,5% 16/4/2050	336.665	0,16
USD 514.000	Mexico Government International Bond 5,75% 12/10/2110	449.174	0,21	USD 600.000	Panama Government International Bond 4,5% 1/4/2056	434.319	0,20
USD 610.000	Mexico Government International Bond 6,338% 4/5/2053	608.170	0,28	USD 640.000	Panama Government International Bond 6,4% 14/2/2035	657.222	0,30
USD 204.000	Mexico Government International Bond 6,35% 9/2/2035	211.874	0,10			8.640.513	4,00
		9.002.456	4,17		Paraguay		
				USD 680.000	Paraguay Government International Bond 2,739% 29/1/2033	536.754	0,25
USD 857.000	Mongolie Mongolia Government International Bond 5,125% 7/4/2026*	795.909	0,37	USD 252.000	Paraguay Government International Bond 4,7% 27/3/2027	243.926	0,11
USD 360.000	Mongolia Government International Bond 8,65% 19/1/2028	361.462	0,17	USD 826.000	Paraguay Government International Bond 4,95% 28/4/2031	782.598	0,36
		1.157.371	0,54	USD 360.000	Paraguay Government International Bond 5% 15/4/2026	352.422	0,17
				USD 340.000	Paraguay Government International Bond 5,4% 30/3/2050	285.155	0,13
						2.200.855	1,02
					Pérou		
USD 590.000	Maroc Morocco Government International Bond 2,375% 15/12/2027	514.495	0,24	USD 915.000	Financiera de Desarrollo 2,4% 28/9/2027	798.722	0,37
USD 658.000	Morocco Government International Bond 3% 15/12/2032*	514.497	0,24	USD 214.000	Financiera de Desarrollo 4,75% 15/7/2025	209.884	0,10
USD 693.000	Morocco Government International Bond 4% 15/12/2050	454.247	0,21	USD 1.210.000	Peruvian Government International Bond 2,392% 23/1/2026	1.133.976	0,52
USD 560.000	Morocco Government International Bond 6,5% 8/9/2033	563.738	0,26	USD 4.829.000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034	3.922.596	1,82
		2.046.977	0,95	USD 638.000	Peruvian Government International Bond 3,23% 28/7/2121	369.169	0,17
				USD 540.000	Peruvian Government International Bond 4,125% 25/8/2027	523.063	0,24
						6.957.410	3,22
					Philippines		
USD 1.093.000	Namibie Namibia International Bonds 5,25% 29/10/2025	1.041.083	0,48	USD 471.000	Philippine Government International Bond 3% 1/2/2028	434.651	0,20
USD 1.476.000	Oman Oman Government International Bond 5,375% 8/3/2027	1.456.406	0,68	USD 780.000	Philippine Government International Bond 3,556% 29/9/2032	700.171	0,32
USD 2.195.000	Oman Government International Bond 5,625% 17/1/2028	2.172.150	1,01	USD 300.000	Philippine Government International Bond 4,2% 21/1/2024	298.351	0,14
USD 1.955.000	Oman Government International Bond 6,5% 8/3/2047	1.840.173	0,85				
USD 334.000	Oman Government International Bond 6,75% 17/1/2048	322.990	0,15				
USD 640.000	Oman Government International Bond 7% 25/1/2051*	634.819	0,29				
		6.426.538	2,98				
USD 2.200.000	Panama Panama Government International Bond 2,252% 29/9/2032	1.669.349	0,77				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 640.000	Philippine Government International Bond 5,5% 17/1/2048	645.059	0,30	USD 1.819.000	Saudi Government International Bond 3,75% 21/1/2055	1.305.069	0,60
		2.078.232	0,96	USD 410.000	Saudi Government International Bond 4,625% 4/10/2047	348.412	0,16
	Pologne			USD 422.000	Saudi Government International Bond 5% 17/4/2049	377.287	0,18
USD 1.072.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375% 22/5/2033*	1.051.900	0,49	USD 776.000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053	690.931	0,32
USD 1.291.000	Republic of Poland Government International Bond 4% 22/1/2024*	1.281.530	0,59			4.763.997	2,21
USD 1.819.000	Republic of Poland Government International Bond 4,875% 4/10/2033	1.766.131	0,82		Sénégal		
USD 665.000	Republic of Poland Government International Bond 5,5% 16/11/2027	677.918	0,31	EUR 480.000	Senegal Government International Bond 4,75% 13/3/2028*	449.875	0,21
USD 565.000	Republic of Poland Government International Bond 5,75% 16/11/2032	588.080	0,27	USD 415.000	Senegal Government International Bond 6,25% 23/5/2033*	340.429	0,16
		5.365.559	2,48	USD 383.000	Senegal Government International Bond 6,75% 13/3/2048	267.244	0,12
						1.057.548	0,49
	Qatar				Serbie		
USD 495.000	Qatar Government International Bond 4,4% 16/4/2050	435.372	0,20	EUR 1.506.000	Serbia International Bond 1% 23/9/2028	1.291.072	0,60
USD 1.403.000	Qatar Government International Bond 4,817% 14/3/2049	1.308.014	0,61	USD 315.000	Serbia International Bond 6,25% 26/5/2028*	313.992	0,14
		1.743.386	0,81			1.605.064	0,74
	Roumanie				Afrique du Sud		
EUR 2.342.000	Romanian Government International Bond 2% 14/4/2033	1.809.303	0,84	ZAR 7.463.316	Republic of South Africa Government Bond 7% 28/2/2031	322.606	0,15
USD 1.116.000	Romanian Government International Bond 3% 27/2/2027	1.025.085	0,47	USD 804.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,3% 12/10/2028	711.604	0,33
USD 1.198.000	Romanian Government International Bond 3% 14/2/2031*	993.130	0,46	USD 1.218.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,85% 30/9/2029	1.074.848	0,50
USD 1.004.000	Romanian Government International Bond 5,125% 15/6/2048*	836.995	0,39	USD 400.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,875% 14/4/2026*	386.212	0,18
USD 1.316.000	Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027	1.293.325	0,60	USD 922.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,65% 27/9/2047*	655.796	0,30
USD 580.000	Romanian Government International Bond 6% 25/5/2034	566.321	0,26	USD 1.604.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,75% 30/9/2049	1.141.735	0,53
USD 1.164.000	Romanian Government International Bond 6,625% 17/2/2028	1.204.525	0,56	USD 1.443.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 22/6/2030	1.317.207	0,61
USD 628.000	Romanian Government International Bond 7,125% 17/1/2033	659.742	0,31	USD 237.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 20/4/2032	210.311	0,09
USD 508.000	Romanian Government International Bond 7,625% 17/1/2053	547.419	0,25	USD 660.000	Republic of South Africa Government International Bond 7,3% 20/4/2052	559.775	0,26
		8.935.845	4,14			6.380.094	2,95
	Rwanda				Sri Lanka		
USD 773.000	Rwanda International Government Bond 5,5% 9/8/2031	601.672	0,28	USD 1.071.000	Sri Lanka Government International Bond 6,125% 3/6/2025	510.449	0,23
	Arabie Saoudite			USD 1.097.000	Sri Lanka Government International Bond 6,2% 11/5/2027	498.625	0,23
USD 1.647.000	Saudi Government International Bond 2,25% 2/2/2033	1.310.905	0,61	USD 264.000	Sri Lanka Government International Bond 6,35% 28/6/2024	123.182	0,06
USD 306.000	Saudi Government International Bond 2,75% 3/2/2032*	261.951	0,12				
USD 705.000	Saudi Government International Bond 3,45% 2/2/2061	469.442	0,22				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.036.000	Sri Lanka Government International Bond 7,55% 28/3/2030	469.329	0,22	USD 260.000	Emirate of Dubai Government International Bonds 5,25% 30/1/2043	237.773	0,11
		1.601.585	0,74	USD 740.000	MDGH GMTN RSC 3% 19/4/2024*	726.199	0,34
	Suède			USD 625.000	MDGH GMTN RSC 3,375% 28/3/2032*	558.953	0,26
EUR 86.368	East Renewable 13,5% 1/1/2025	11.713	0,01	USD 829.000	UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 4,951% 7/7/2052	786.961	0,37
	Trinité-et-Tobago					6.221.165	2,88
USD 447.000	Trinidad & Tobago Government International Bond 4,5% 4/8/2026*	433.367	0,20		Royaume-Uni		
USD 200.000	Trinidad Generation 5,25% 4/11/2027	194.136	0,09	USD 349.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance 7,625% 8/11/2026	138.398	0,06
		627.503	0,29				
	Ukraine				Uruguay		
USD 1.010.000	NPC Ukrenergo 6,875% 9/11/2028	282.800	0,13	USD 1.594.027	Uruguay Government International Bond 4,125% 20/11/2045	1.407.956	0,65
USD 775.000	Ukraine Government International Bond 6,876% 21/5/2031	206.538	0,09	USD 1.778.200	Uruguay Government International Bond 4,375% 23/1/2031	1.751.750	0,81
USD 779.000	Ukraine Government International Bond 7,253% 15/3/2035	210.961	0,10	USD 769.973	Uruguay Government International Bond 4,975% 20/4/2055	725.707	0,34
USD 400.000	Ukraine Government International Bond 7,375% 25/9/2034	106.500	0,05	USD 1.306.128	Uruguay Government International Bond 5,1% 18/6/2050	1.258.539	0,58
USD 763.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2025	247.975	0,11			5.143.952	2,38
USD 6.592.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2026	1.921.568	0,89		Uzbekistan		
USD 2.410.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2027	694.923	0,32	USD 470.000	Republic of Uzbekistan International Bond 5,375% 20/2/2029	430.809	0,20
USD 1.842.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2029	532.338	0,25		Zambie		
USD 2.297.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/8/2041	1.056.620	0,49	USD 323.000	Zambia Government International Bond 5,375% 20/9/2022***	155.250	0,07
		5.260.223	2,43	USD 200.000	Zambia Government International Bond 8,5% 14/4/2024	106.215	0,05
				USD 275.000	Zambia Government International Bond 8,97% 30/7/2027	144.660	0,07
	Émirats arabes unis					406.125	0,19
USD 1.411.000	Abu Dhabi Commercial Bank 4,5% 14/9/2027*	1.372.056	0,63		Total des obligations	196.554.928	90,97
USD 1.348.000	Abu Dhabi Government International Bond 1,7% 2/3/2031	1.102.004	0,51		Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	196.554.928	90,97
USD 993.000	Abu Dhabi Government International Bond 3,125% 30/9/2049	696.624	0,32		Total du portefeuille	196.554.928	90,97
USD 920.000	Abu Dhabi Government International Bond 3,875% 16/4/2050*	740.595	0,34		Autres éléments de l'actif net	19.504.230	9,03
					Total de l'actif net (USD)	216.059.158	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Sustainable Emerging Markets Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	1.500.500	USD	1.002.936	Royal Bank of Canada	13/9/2023	(30.662)
BRL	15.155.988	USD	3.190.090	JP Morgan	5/9/2023	(114.377)
BRL	7.881.000	USD	1.604.112	Goldman Sachs	5/9/2023	(4.764)
BRL	14.200.308	USD	2.885.198	Goldman Sachs	3/10/2023	(16.559)
EUR	400.000	USD	439.167	Royal Bank of Canada	13/9/2023	(4.999)
EUR	750.000	USD	815.437	UBS	13/9/2023	(1.374)
EUR	900.000	USD	978.876	BNY Mellon	13/9/2023	(2.000)
GBP	120.000	USD	153.173	Royal Bank of Canada	13/9/2023	(1.049)
HUF	799.130.000	USD	2.263.247	Morgan Stanley	13/9/2023	12.338
HUF	30.430.330	USD	85.571	Barclays	13/9/2023	1.082
JPY	292.067.540	USD	2.051.105	Morgan Stanley	13/9/2023	(49.880)
MXN	20.700.440	USD	1.196.178	Barclays	13/9/2023	38.811
MXN	78.360.000	USD	4.554.222	Morgan Stanley	13/9/2023	120.735
MXN	64.460.000	USD	3.752.832	JP Morgan	13/9/2023	92.851
PLN	6.940.000	USD	1.709.613	Barclays	13/9/2023	(25.610)
PLN	9.040.000	USD	2.224.272	Goldman Sachs	13/9/2023	(30.701)
PLN	9.430.000	USD	2.337.279	Morgan Stanley	13/9/2023	(49.073)
PLN	7.053.000	USD	1.737.098	UBS	13/9/2023	(25.675)
PLN	443.490	USD	106.979	RBS	13/9/2023	634
TRY	3.690.140	USD	128.925	Morgan Stanley	17/10/2023	5.445
TRY	21.660.100	USD	794.866	Goldman Sachs	17/10/2023	(6.149)
USD	1.529.265	PLN	6.304.700	Bank of America	13/9/2023	(582)
USD	1.962.602	MXN	33.882.359	Bank of America	13/9/2023	(58.820)
USD	1.667.767	HUF	593.474.707	Toronto-Dominion	13/9/2023	(22.199)
USD	13.595.308	EUR	12.453.238	Morgan Stanley	13/9/2023	78.338
USD	1.439.980	COP	6.089.676.820	JP Morgan	13/9/2023	(38.588)
USD	2.147.780	ZAR	41.370.000	UBS	13/9/2023	(52.178)
USD	2.151.131	MXN	37.760.000	JP Morgan	13/9/2023	(101.631)
USD	2.921.057	PLN	12.020.000	Goldman Sachs	13/9/2023	4.383
USD	1.771.001	TRY	50.193.535	UBS	17/10/2023	(56.714)
USD	1.772.536	EUR	1.590.000	BNY Mellon	13/9/2023	46.722
USD	1.125.199	HUF	402.720.000	Goldman Sachs	13/9/2023	(21.578)
USD	538.981	EUR	490.000	JP Morgan	13/9/2023	7.126
USD	1.832.372	BRL	8.836.680	JP Morgan	5/9/2023	39.082
USD	1.151.466	HUF	412.950.000	JP Morgan	13/9/2023	(24.441)
USD	1.112.707	PLN	4.520.000	Morgan Stanley	13/9/2023	15.921
USD	2.662.624	MXN	45.270.000	Goldman Sachs	13/9/2023	(38.184)
USD	392.839	PLN	1.602.508	BNP Paribas	13/9/2023	3.988
USD	1.922.042	PLN	7.837.492	UBS	13/9/2023	20.261
USD	4.581.790	MXN	78.720.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(114.645)
USD	1.755.648	PLN	7.100.000	Toronto-Dominion	13/9/2023	32.821
USD	1.255.648	ZAR	24.180.000	Barclays	13/9/2023	(30.187)
USD	64.841	ZAR	1.213.610	Toronto-Dominion	13/9/2023	304
USD	2.897.957	BRL	14.200.308	Goldman Sachs	5/9/2023	16.187
ZAR	61.840.699	USD	3.250.908	Morgan Stanley	13/9/2023	37.633
ZAR	21.020.000	USD	1.108.668	Barclays	13/9/2023	9.126
Moins-value nette non réalisée						(338.831)
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	7.046	USD	4.589	BNY Mellon	15/9/2023	(23)
USD	91	AUD	141	BNY Mellon	15/9/2023	(1)
Moins-value nette non réalisée						(24)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	28.663.801	USD	32.819.400	BNY Mellon	15/9/2023	(326.050)
USD	724.853	CHF	635.564	BNY Mellon	15/9/2023	4.379
Moins-value nette non réalisée						(321.671)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	153.053.182	USD	167.924.889	BNY Mellon	15/9/2023	(1.781.160)
USD	17.767.772	EUR	16.362.008	BNY Mellon	15/9/2023	6.429
Moins-value nette non réalisée						(1.774.731)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	11.464	USD	14.576	BNY Mellon	15/9/2023	(43)
USD	272	GBP	214	BNY Mellon	15/9/2023	1
Moins-value nette non réalisée						(42)
Catégorie d'Actions couverte en NOK						
NOK	185.816.749	USD	18.094.124	BNY Mellon	15/9/2023	(638.400)
USD	359.591	NOK	3.815.337	BNY Mellon	15/9/2023	1.180
Moins-value nette non réalisée						(637.220)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	4.973	USD	3.695	BNY Mellon	15/9/2023	(14)
USD	75	SGD	101	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(14)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 325.840.315)						(3.072.533)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
19	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	2.741.656	18.867
5	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	554.453	4.233
(7)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	811.891	(8.914)
8	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	1.035.750	10.437
17	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	1.815.680	10.758
Total				6.959.430	35.381

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 1.141.400	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(55.455)	50.185
CDS	USD (358.000)	Fund provides default protection on Mexican; and receives Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	359	163
CDS	USD (2.000.000)	Fund provides default protection on Mexican; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	7.796	912
CDS	USD (585.000)	Fund provides default protection on South Africa; and receives Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(529)	(34.633)
CDS	USD 2.000.000	Fund receives default protection on Chile; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(8.215)	(37.135)
CDS	USD 1.000.000	Fund receives default protection on Chile; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(3.518)	(18.568)
CDS	USD 700.000	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(65.257)	75.693
CDS	USD 2.297.200	Fund receives default protection on Turkey; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(125.931)	248.402
CDS	USD 2.270.100	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(99.644)	60.992
IRS	USD 125.000	Fund receives Fixed 3,5783%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14/8/2053	938	938
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 12.935.268)					(349.456)	346.949

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
Argentine							
USD 698.000	YPF 6,95% 21/7/2027	590.295	1,11	USD 568.000	Colombie Banco Davivienda 6,65% 22/4/2031	419.752	0,79
USD 196.282	YPF 9% 12/2/2026*	193.591	0,36	USD 163.000	Ecopetrol 4,125% 16/1/2025	157.939	0,30
				USD 180.000	Ecopetrol 4,625% 2/11/2031*	141.630	0,26
				USD 200.000	Ecopetrol 6,875% 29/4/2030	186.050	0,35
				USD 330.000	Promigas / Gases del Pacifico 3,75% 16/10/2029	278.355	0,53
		783.886	1,47			1.183.726	2,23
Bermudes				Hong Kong			
USD 359.000	Geopark 5,5% 17/1/2027*	306.796	0,58	USD 400.000	Cathay Pacific MTN Financing HK 4,875% 17/8/2026	384.378	0,72
USD 888.000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4,85% 14/10/2038	781.338	1,47	USD 639.000	Lenovo 3,421% 2/11/2030*	532.808	1,00
		1.088.134	2,05			917.186	1,72
Brésil				Hongrie			
USD 540.000	Banco do Brasil 6,25% 18/4/2030	536.301	1,01	USD 535.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6,5% 29/6/2028	539.146	1,01
				USD 658.000	MVM Energetika Zrt 7,5% 9/6/2028	670.338	1,26
						1.209.484	2,27
Îles Vierges britanniques				Indonésie			
USD 824.000	Central American Bottling / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL 5,25% 27/4/2029	754.318	1,42	USD 560.000	Freeport Indonesia 6,2% 14/4/2052*	498.324	0,94
USD 679.000	Gold Fields Orogen BVI 5,125% 15/5/2024	672.831	1,27	USD 777.000	Pertamina Geothermal Energy 5,15% 27/4/2028	768.259	1,45
USD 762.963	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6,75% 24/4/2033	744.186	1,40	USD 590.000	Pertamina Persero 1,4% 9/2/2026	534.319	1,00
		2.171.335	4,09			1.800.902	3,39
Îles Caïmans				Île de Man			
USD 550.000	Aldar Sukuk No 2 3,875% 22/10/2029*	509.126	0,96	USD 899.000	AngloGold Ashanti 3,375% 1/11/2028*	779.352	1,47
USD 400.000	Baidu 1,72% 9/4/2026	361.886	0,68	USD 321.000	AngloGold Ashanti 3,75% 1/10/2030	267.008	0,50
USD 625.000	CK Hutchison International 23 4,75% 21/4/2028	609.269	1,15			1.046.360	1,97
USD 251.000	Dar Al-Arkan Sukuk 7,75% 7/2/2026	251.922	0,47	Israël			
USD 525.000	Dar Al-Arkan Sukuk 8% 25/2/2029	525.945	0,99	USD 310.000	Bank Hapoalim 3,255% 21/1/2032*	266.332	0,50
USD 455.000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	453.150	0,85	USD 307.000	Bank Leumi Le-Israel 3,275% 29/1/2031	276.613	0,52
USD 600.000	Gaci First Investment 4,875% 14/2/2035	567.072	1,07	USD 505.729	Energian Israel Finance 4,5% 30/3/2024*	500.672	0,94
USD 278.000	IHS 5,625% 29/11/2026	240.064	0,45	USD 401.589	Energian Israel Finance 4,875% 30/3/2026	377.590	0,71
USD 485.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10,875% 15/1/2031	487.934	0,92	USD 570.000	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033	577.837	1,09
USD 500.000	MAF Global 6,375% 20/3/2026	486.658	0,92	USD 693.000	Mizrahi Tefahot Bank 3,077% 7/4/2031*	607.675	1,15
USD 500.000	MAF Sukuk 5% 1/6/2033*	494.228	0,93			2.606.719	4,91
USD 787.000	QNB Finance 1,375% 26/1/2026*	713.179	1,34	Kazakhstan			
USD 703.000	Yuzhou 8,3% 27/5/2025***	36.029	0,07	USD 200.000	KazMunayGas National JSC 4,75% 19/4/2027	188.315	0,35
		5.736.462	10,80	USD 231.000	KazMunayGas National JSC 5,375% 24/4/2030*	210.841	0,40
				USD 309.000	KazMunayGas National JSC 6,375% 24/10/2048	258.285	0,49
Chili						657.441	1,24
USD 674.000	Banco de Credito e Inversiones 3,5% 12/10/2027	620.532	1,17	Luxembourg			
USD 930.000	CAP 3,9% 27/4/2031	697.891	1,31	USD 817.000	CSN Resources 4,625% 10/6/2031	621.083	1,17
USD 349.000	Embotelladora Andina 3,95% 21/1/2050*	266.168	0,50	USD 600.000	MHP Lux 6,25% 19/9/2029	332.634	0,63
USD 328.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones 3,05% 14/9/2032	255.712	0,48	USD 657.900	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028*	592.521	1,11
USD 227.000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones 4,75% 1/8/2026	219.667	0,42	USD 300.000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	276.243	0,52
USD 775.000	Empresa Nacional del Petroleo 6,15% 10/5/2033	767.118	1,44			1.822.481	3,43
		2.827.088	5,32				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Maurice				Singapour			
USD 532.000	Diamond II 7,95% 28/7/2026*	524.099	0,99	USD 557.000	BOC Aviation 3,5% 18/9/2027	520.066	0,98
USD 877.415	Greenko Power II 4,3% 13/12/2028	762.842	1,43	USD 270.000	Continuum Energy Aura 9,5% 24/2/2027	270.337	0,51
USD 744.000	Network i2i 5,65% 15/1/2025	724.221	1,36	USD 604.268	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027*	564.235	1,06
		2.011.162	3,78			1.354.638	2,55
Mexique				Afrique du Sud			
USD 624.000	Alpek 4,25% 18/9/2029*	559.126	1,05	USD 262.000	Transnet SOC 8,25% 6/2/2028	255.053	0,48
USD 380.000	Banco Mercantil del Norte 6,625% 24/1/2032	307.496	0,58	Corée du Sud			
USD 335.000	Banco Mercantil del Norte 7,625% 10/1/2028*	314.176	0,59	USD 545.000	GS Caltex 5,375% 7/8/2028	541.114	1,02
USD 525.000	BBVA Bancomer 5,875% 13/9/2034	467.904	0,88	USD 200.000	SK Hynix 6,25% 17/1/2026	200.826	0,38
USD 886.000	Cemex 5,125% 8/6/2026*	822.182	1,55			741.940	1,40
USD 252.000	Cemex 9,125% 14/3/2028*	263.118	0,49	Thaïlande			
USD 703.000	Cibanco Ibm / PLA Administradora Industrial S de RL 4,962% 18/7/2029	655.361	1,23	USD 389.000	PTTEP Treasury Center 3,903% 6/12/2059	271.187	0,51
USD 457.928	Grupo Posadas 5% 30/12/2027	392.749	0,74	USD 390.000	Thaioil Treasury Center 3,75% 18/6/2050	250.552	0,47
USD 633.000	Industrias Penoles 4,15% 12/9/2029	571.710	1,08	USD 316.000	Thaioil Treasury Center 4,875% 23/1/2043	255.078	0,48
USD 1.068.000	Inmobiliaria Vesta 3,625% 13/5/2031	880.614	1,66			776.817	1,46
USD 524.000	Metalsa Sapi 3,75% 4/5/2031	408.528	0,77	Turquie			
USD 538.000	Orbia Advance 5,5% 15/1/2048	436.554	0,82	USD 289.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri 5,8% 11/4/2028*	268.549	0,51
USD 298.000	Trust Fibra Uno 4,869% 15/1/2030	260.384	0,49	USD 819.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari 6,95% 14/3/2026	803.574	1,51
		6.339.902	11,93			1.072.123	2,02
Pays-Bas				Ukraine			
USD 471.000	Arcos Dorados 6,125% 27/5/2029*	454.421	0,85	USD 200.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding 6,2% 11/2/2025	148.000	0,28
USD 632.000	MEGlobal 2,625% 28/4/2028*	558.166	1,05	Émirats arabes unis			
USD 1.195.000	Prosus 3,061% 13/7/2031	909.419	1,71	USD 780.000	Abu Dhabi Commercial Bank 4,5% 14/9/2027	758.472	1,43
USD 400.000	Prosus 4,987% 19/1/2052*	269.960	0,51	USD 520.000	Alpha Star VII 7,75% 27/4/2026	527.147	0,99
EUR 267.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3,75% 9/5/2027	265.531	0,50	USD 323.000	DP World/United Arab Emirates 4,7% 30/9/2049	267.208	0,50
USD 425.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 4,75% 9/5/2027	396.041	0,75	USD 351.000	Emirates NBD Bank 5,625% 21/10/2027	357.752	0,67
USD 200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 7,875% 15/9/2029	208.805	0,39			1.910.579	3,59
		3.062.343	5,76	Royaume-Uni			
Panama				USD 550.000	Anglo American Capital 5,5% 2/5/2033	531.275	1,00
USD 518.317	AES Panama Generation 4,375% 31/5/2030	451.584	0,85	USD 270.000	Standard Chartered 7,202% 6/7/2027	272.200	0,51
USD 692.000	Telecomunicaciones Digitales 4,5% 30/1/2030	588.667	1,11			803.475	1,51
		1.040.251	1,96	États-Unis			
Paraguay				USD 380.000	Azul Secured Finance 11,93% 28/8/2028	378.425	0,71
USD 788.000	Telefonica Celular del Paraguay 5,875% 15/4/2027	742.028	1,40	USD 660.000	MercadoLibre 3,125% 14/1/2031	525.129	0,99
Pérou				USD 877.000	SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	662.714	1,25
USD 975.000	InRetail Consumer 3,25% 22/3/2028	843.471	1,59	USD 655.000	Stillwater Mining 4,5% 16/11/2029	518.016	0,98
USD 906.000	Minsur 4,5% 28/10/2031*	781.788	1,47	USD 1.500.000	United States Treasury Bill 0% 21/11/2023	1.482.146	2,79
		1.625.259	3,06	USD 1.245.000	United States Treasury Bill 0% 15/2/2024	1.214.443	2,29
Pologne						4.780.873	9,01
USD 541.000	Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375% 22/5/2033	530.856	1,00	Total des obligations			
Arabie Saoudite				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
USD 545.000	Almarai JSC 5,233% 25/7/2033*	551.050	1,04			52.133.854	98,13

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Autres titres négociables			
OBLIGATIONS			
	Bermudes		
USD 274.708	DGL2 8,25% 30/9/2022**,**	–	0,00
Total des obligations		–	0,00
Total des autres valeurs mobilières		–	0,00
Total du portefeuille		52.133.854	98,13
Autres éléments de l'actif net		993.159	1,87
Total de l'actif net (USD)		53.127.013	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
GBP	20.000	USD	25.540	Royal Bank of Canada	13/9/2023	(186)
GBP	10.000	USD	12.783	RBS	13/9/2023	(106)
USD	269.669	EUR	250.000	Bank of America	20/9/2023	(1.777)
Moins-value nette non réalisée						(2.069)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	2.349.150	USD	2.690.097	BNY Mellon	15/9/2023	(27.096)
USD	31.885	CHF	27.943	BNY Mellon	15/9/2023	209
Moins-value nette non réalisée						(26.887)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	19.252.180	USD	21.121.879	BNY Mellon	15/9/2023	(223.073)
USD	493.102	EUR	451.250	BNY Mellon	15/9/2023	3.259
Moins-value nette non réalisée						(219.814)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	12.671.965	USD	1.186.396	BNY Mellon	15/9/2023	(24.170)
USD	7.876	SEK	86.117	BNY Mellon	15/9/2023	(22)
Moins-value nette non réalisée						(24.192)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 25.547.468)						(272.962)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
36	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	7.332.187	19.969
Total				7.332.187	19.969

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 2.189.479	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	(66.476)	38.748
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.147.835)					(66.476)	38.748

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				CNY 770.000	China Government Bond 3,29% 23/5/2029	110.475	0,02
				CNY 3.590.000	China Government Bond 3,72% 12/4/2051	566.408	0,11
				CNY 11.170.000	China Government Bond 3,81% 14/9/2050	1.783.374	0,35
				9.615.932 1,90			
OBLIGATIONS							
Brésil							
BRL 19.094.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2024	3.552.657	0,70				
BRL 11.047.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2025	1.876.622	0,37				
BRL 65.477.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/1/2026	10.592.105	2,09				
BRL 12.595.000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2026	1.946.837	0,38				
BRL 23.330.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	4.778.533	0,94				
BRL 49.314.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	9.931.564	1,96				
BRL 61.161.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2029	12.088.093	2,38				
BRL 42.068.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2031	8.288.994	1,64				
BRL 11.101.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2033	2.155.466	0,43				
		55.210.871	10,89				
Colombie							
		USD 3.334.000		USD 3.334.000	Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031*	2.571.348	0,51
		USD 680.000		USD 680.000	Colombia Government International Bond 7,5% 2/2/2034	674.611	0,13
COP 20.214.900.000	Colombian TES 6% 28/4/2028	4.222.760	0,83	COP 20.214.900.000	Colombian TES 6% 28/4/2028	4.222.760	0,83
COP 4.628.000.000	Colombian TES 6,25% 26/11/2025	1.054.534	0,21	COP 4.628.000.000	Colombian TES 6,25% 26/11/2025	1.054.534	0,21
COP 57.445.200.000	Colombian TES 7% 26/3/2031	11.599.943	2,29	COP 57.445.200.000	Colombian TES 7% 26/3/2031	11.599.943	2,29
COP 9.941.100.000	Colombian TES 7% 26/3/2031	2.016.978	0,40	COP 9.941.100.000	Colombian TES 7% 26/3/2031	2.016.978	0,40
COP 5.011.400.000	Colombian TES 7% 30/6/2032	985.711	0,19	COP 5.011.400.000	Colombian TES 7% 30/6/2032	985.711	0,19
COP 11.813.200.000	Colombian TES 7,25% 18/10/2034	2.258.437	0,45	COP 11.813.200.000	Colombian TES 7,25% 18/10/2034	2.258.437	0,45
COP 5.437.500.000	Colombian TES 7,25% 26/10/2050	909.785	0,18	COP 5.437.500.000	Colombian TES 7,25% 26/10/2050	909.785	0,18
COP 11.385.900.000	Colombian TES 7,5% 26/8/2026	2.612.617	0,52	COP 11.385.900.000	Colombian TES 7,5% 26/8/2026	2.612.617	0,52
COP 14.933.000.000	Colombian TES 7,75% 18/9/2030	3.220.613	0,63	COP 14.933.000.000	Colombian TES 7,75% 18/9/2030	3.220.613	0,63
COP 14.540.800.000	Colombian TES 9,25% 28/5/2042	3.074.860	0,61	COP 14.540.800.000	Colombian TES 9,25% 28/5/2042	3.074.860	0,61
		35.202.197	6,95				
Chili							
CLP 4.175.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 2,3% 1/10/2028	4.217.629	0,83				
CLP 2.625.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,5% 1/3/2026	2.982.606	0,59				
CLP 1.130.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,7% 1/9/2030	1.247.372	0,25				
CLP 375.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5% 1/10/2028	436.051	0,08				
CLP 405.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5% 1/3/2035	447.301	0,09				
USD 2.640.000	Chile Government International Bond 2,55% 27/1/2032*	2.220.583	0,44				
USD 1.581.000	Chile Government International Bond 4,34% 7/3/2042	1.359.707	0,27				
		12.911.249	2,55				
Chine							
CNY 4.810.000	China Government Bond 2,68% 21/5/2030	665.139	0,13				
CNY 6.500.000	China Government Bond 2,85% 4/6/2027	907.860	0,18				
CNY 6.900.000	China Government Bond 2,88% 25/2/2033	968.548	0,19				
CNY 14.320.000	China Government Bond 3,02% 22/10/2025	2.005.056	0,40				
CNY 5.660.000	China Government Bond 3,02% 27/5/2031	801.400	0,16				
CNY 7.850.000	China Government Bond 3,13% 21/11/2029	1.117.698	0,22				
CNY 70.000	China Government Bond 3,25% 22/11/2028	10.018	0,00				
CNY 4.710.000	China Government Bond 3,27% 19/11/2030	679.956	0,14				
République tchèque							
CZK 65.070.000	Czech Republic Government Bond 0% 12/12/2024*	2.740.973	0,54	CZK 65.070.000	Czech Republic Government Bond 0% 12/12/2024*	2.740.973	0,54
CZK 29.320.000	Czech Republic Government Bond 0,05% 29/11/2029*	1.016.121	0,20	CZK 29.320.000	Czech Republic Government Bond 0,05% 29/11/2029*	1.016.121	0,20
CZK 76.740.000	Czech Republic Government Bond 0,25% 10/2/2027	2.987.950	0,59	CZK 76.740.000	Czech Republic Government Bond 0,25% 10/2/2027	2.987.950	0,59
CZK 70.650.000	Czech Republic Government Bond 0,95% 15/5/2030*	2.565.003	0,51	CZK 70.650.000	Czech Republic Government Bond 0,95% 15/5/2030*	2.565.003	0,51
CZK 59.140.000	Czech Republic Government Bond 1% 26/6/2026	2.412.538	0,48	CZK 59.140.000	Czech Republic Government Bond 1% 26/6/2026	2.412.538	0,48
CZK 97.300.000	Czech Republic Government Bond 1,2% 13/3/2031	3.523.337	0,69	CZK 97.300.000	Czech Republic Government Bond 1,2% 13/3/2031	3.523.337	0,69
CZK 34.300.000	Czech Republic Government Bond 1,25% 14/2/2025	1.459.639	0,29	CZK 34.300.000	Czech Republic Government Bond 1,25% 14/2/2025	1.459.639	0,29
CZK 117.060.000	Czech Republic Government Bond 1,75% 23/6/2032	4.321.437	0,85	CZK 117.060.000	Czech Republic Government Bond 1,75% 23/6/2032	4.321.437	0,85
CZK 162.980.000	Czech Republic Government Bond 2% 13/10/2033	5.978.748	1,18	CZK 162.980.000	Czech Republic Government Bond 2% 13/10/2033	5.978.748	1,18
CZK 35.340.000	Czech Republic Government Bond 2,4% 17/9/2025	1.515.738	0,30	CZK 35.340.000	Czech Republic Government Bond 2,4% 17/9/2025	1.515.738	0,30
CZK 33.700.000	Czech Republic Government Bond 2,5% 25/8/2028*	1.388.510	0,27	CZK 33.700.000	Czech Republic Government Bond 2,5% 25/8/2028*	1.388.510	0,27
CZK 78.540.000	Czech Republic Government Bond 2,75% 23/7/2029	3.241.607	0,64	CZK 78.540.000	Czech Republic Government Bond 2,75% 23/7/2029	3.241.607	0,64
CZK 31.870.000	Czech Republic Government Bond 4,2% 4/12/2036	1.409.297	0,28	CZK 31.870.000	Czech Republic Government Bond 4,2% 4/12/2036	1.409.297	0,28
CZK 51.740.000	Czech Republic Government Bond 5,7% 25/5/2024	2.335.344	0,46	CZK 51.740.000	Czech Republic Government Bond 5,7% 25/5/2024	2.335.344	0,46
CZK 26.460.000	Czech Republic Government Bond 6% 26/2/2026	1.230.956	0,24	CZK 26.460.000	Czech Republic Government Bond 6% 26/2/2026	1.230.956	0,24
		38.127.198	7,52				
République dominicaine							
		USD 1.425.000		USD 1.425.000	Dominican Republic International Bond 5,5% 22/2/2029	1.334.142	0,26

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
DOP 32.700.000	Dominican Republic International Bond 13,625% 3/2/2033	703.550	0,14	IDR 12.673.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/6/2032	931.545	0,18
		2.037.692	0,40	IDR 59.580.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2036	4.445.732	0,88
	Égypte			IDR 37.420.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/9/2026	2.600.727	0,51
EGP 12.239.000	Egypt Government Bond 14,82% 6/7/2031	216.413	0,04	IDR 36.572.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/3/2034	2.738.698	0,54
USD 3.444.000	Egypt Government International Bond 8,875% 29/5/2050	1.853.423	0,37	IDR 12.316.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375% 15/4/2039	940.075	0,19
		2.069.836	0,41	IDR 15.957.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,75% 15/5/2031	1.192.846	0,24
	Hongrie			IDR 24.275.000.000	Indonesia Treasury Bond 9% 15/3/2029	1.791.536	0,35
HUF 427.300.000	Hungary Government Bond 1% 26/11/2025	1.043.201	0,21	IDR 18.017.000.000	Indonesia Treasury Bond 9,5% 15/7/2031	1.403.622	0,28
HUF 505.060.000	Hungary Government Bond 1,5% 22/4/2026	1.222.835	0,24	IDR 19.310.000.000	Indonesia Treasury Bond 10,5% 15/8/2030	1.560.775	0,31
HUF 216.210.000	Hungary Government Bond 1,5% 26/8/2026*	515.712	0,10	IDR 32.552.000.000	Indonesia Treasury Bond 11% 15/9/2025	2.329.723	0,46
HUF 969.340.000	Hungary Government Bond 2,5% 24/10/2024*	2.570.199	0,51			51.462.159	10,15
HUF 867.430.000	Hungary Government Bond 2,75% 22/12/2026	2.115.028	0,42		Malaisie		
HUF 483.540.000	Hungary Government Bond 3% 27/10/2027*	1.175.877	0,23	MYR 7.655.000	Malaysia Government Bond 2,632% 15/4/2031	1.521.298	0,30
HUF 1.253.400.000	Hungary Government Bond 3% 21/8/2030	2.833.069	0,56	MYR 6.957.000	Malaysia Government Bond 3,502% 31/5/2027	1.497.276	0,29
HUF 694.130.000	Hungary Government Bond 3,25% 22/10/2031*	1.558.006	0,31	MYR 10.769.000	Malaysia Government Bond 3,519% 20/4/2028	2.313.013	0,46
HUF 749.760.000	Hungary Government Bond 4% 28/4/2051*	1.348.260	0,27	MYR 23.274.000	Malaysia Government Bond 3,582% 15/7/2032	4.915.149	0,97
HUF 1.237.960.000	Hungary Government Bond 4,75% 24/11/2032	3.004.830	0,59	MYR 20.282.000	Malaysia Government Bond 3,733% 15/6/2028	4.388.143	0,86
HUF 594.280.000	Hungary Government Bond 5,5% 24/6/2025	1.601.966	0,32	MYR 6.816.000	Malaysia Government Bond 3,757% 22/5/2040	1.404.058	0,28
HUF 750.780.000	Hungary Government Bond 6,75% 22/10/2028	2.098.522	0,41	MYR 9.962.000	Malaysia Government Bond 3,828% 5/7/2034	2.123.601	0,42
EUR 640.000	Hungary Government International Bond 1,75% 5/6/2035	485.264	0,09	MYR 14.779.000	Malaysia Government Bond 3,844% 15/4/2033	3.177.164	0,63
USD 2.237.000	Hungary Government International Bond 6,25% 22/9/2032*	2.257.771	0,44	MYR 10.957.000	Malaysia Government Bond 3,885% 15/8/2029	2.382.851	0,47
		23.830.540	4,70	MYR 11.247.000	Malaysia Government Bond 3,892% 15/3/2027	2.451.311	0,48
	Indonésie			MYR 5.268.000	Malaysia Government Bond 3,9% 30/11/2026	1.149.854	0,23
IDR 25.553.000.000	Indonesia Treasury Bond 5,5% 15/4/2026	1.651.801	0,33	MYR 7.143.000	Malaysia Government Bond 4,065% 15/6/2050	1.483.311	0,29
IDR 42.077.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,125% 15/5/2028	2.747.575	0,54	MYR 5.932.000	Malaysia Government Bond 4,232% 30/6/2031	1.312.064	0,26
IDR 81.022.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,375% 15/4/2032	5.322.555	1,05	MYR 11.454.000	Malaysia Government Bond 4,392% 15/4/2026	2.526.420	0,50
IDR 75.993.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,5% 15/2/2031	5.022.124	0,99	MYR 2.760.000	Malaysia Government Bond 4,457% 31/3/2053	614.572	0,12
IDR 20.405.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	1.373.954	0,27	MYR 3.556.000	Malaysia Government Bond 4,498% 15/4/2030	800.099	0,16
IDR 27.678.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/9/2030	1.881.849	0,37	MYR 10.095.000	Malaysia Government Bond 4,696% 15/10/2042	2.332.640	0,46
IDR 110.966.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/2/2033	7.610.242	1,50	MYR 4.331.000	Malaysia Government Bond 4,736% 15/3/2046	998.743	0,20
IDR 33.577.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2038	2.340.248	0,46	MYR 5.508.000	Malaysia Government Bond 4,762% 7/4/2037	1.275.707	0,25
IDR 15.032.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2042	1.033.882	0,20	MYR 8.740.000	Malaysia Government Bond 4,893% 8/6/2038	2.061.857	0,41
IDR 24.506.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,5% 15/8/2032	1.724.109	0,34			40.729.131	8,04
IDR 11.559.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,5% 15/5/2038	818.541	0,16		Mexique		
				MXN 39.464.400	Mexican Bonos 5,5% 4/3/2027	2.064.174	0,41
				MXN 148.172.020	Mexican Bonos 5,75% 5/3/2026	8.012.739	1,58
				MXN 134.967.890	Mexican Bonos 7,5% 3/6/2027	7.513.421	1,48

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
MXN 36.156.700	Mexican Bonos 7,5% 26/5/2033	1.910.372	0,38	RON 6.850.000	Romania Government Bond 4,25% 28/4/2036	1.187.252	0,23
MXN 154.100.360	Mexican Bonos 7,75% 29/5/2031	8.383.097	1,65	RON 12.750.000	Romania Government Bond 4,75% 11/10/2034	2.368.651	0,47
MXN 37.797.500	Mexican Bonos 7,75% 23/11/2034	2.016.229	0,40	RON 6.780.000	Romania Government Bond 4,85% 25/7/2029	1.374.889	0,27
MXN 56.037.670	Mexican Bonos 7,75% 13/11/2042	2.850.353	0,56	RON 5.130.000	Romania Government Bond 5% 12/2/2029	1.054.509	0,21
MXN 44.610	Mexican Bonos 8% 7/12/2023	2.643	0,00	RON 7.320.000	Romania Government Bond 5,8% 26/7/2027	1.578.000	0,31
MXN 17.299.700	Mexican Bonos 8% 5/9/2024	1.002.505	0,20	RON 16.190.000	Romania Government Bond 6,7% 25/2/2032	3.548.747	0,70
MXN 60.000.000	Mexican Bonos 8% 24/5/2035	3.258.995	0,64	RON 10.870.000	Romania Government Bond 8,25% 29/9/2032	2.626.152	0,52
MXN 94.931.830	Mexican Bonos 8% 7/11/2047	4.935.572	0,97	EUR 1.176.000	Romanian Government International Bond 2,75% 26/2/2026*	1.217.466	0,24
MXN 32.307.400	Mexican Bonos 8% 31/7/2053	1.664.655	0,33	EUR 622.000	Romanian Government International Bond 3,624% 26/5/2030	596.582	0,12
MXN 106.851.200	Mexican Bonos 8,5% 31/5/2029	6.132.797	1,21	USD 2.572.000	Romanian Government International Bond 7,125% 17/1/2033	2.702.002	0,53
MXN 47.896.530	Mexican Bonos 8,5% 18/11/2038	2.646.323	0,52			23.193.081	4,58
MXN 93.854.980	Mexican Bonos 10% 5/12/2024	5.554.048	1,10				
MXN 25.694.380	Mexican Bonos 10% 20/11/2036	1.614.637	0,32				
		59.562.560	11,75				
	Pérou				Serbie		
PEN 17.568.000	Peruvian Government International Bond 6,35% 12/8/2028	4.845.307	0,96	EUR 2.106.000	Serbia International Bond 1% 23/9/2028	1.805.444	0,35
PEN 34.719.000	Peruvian Government International Bond 6,95% 12/8/2031	9.658.211	1,90	USD 1.663.000	Serbia International Bond 6,25% 26/5/2028*	1.657.678	0,33
PEN 5.979.000	Peruvian Government International Bond 8,2% 12/8/2026	1.718.093	0,34			3.463.122	0,68
		16.221.611	3,20				
	Pologne				Afrique du Sud		
PLN 15.920.000	Republic of Poland Government Bond 0,25% 25/10/2026	3.315.772	0,65	ZAR 29.384.424	Republic of South Africa Government Bond 6,25% 31/3/2036*	1.003.236	0,20
PLN 11.666.000	Republic of Poland Government Bond 1,25% 25/10/2030	2.144.249	0,42	ZAR 30.845.650	Republic of South Africa Government Bond 6,5% 28/2/2041	970.122	0,19
PLN 30.110.000	Republic of Poland Government Bond 1,75% 25/4/2032	5.429.419	1,07	ZAR 327.356.148	Republic of South Africa Government Bond 7% 28/2/2031*	14.150.141	2,79
PLN 7.451.000	Republic of Poland Government Bond 2,5% 25/7/2026	1.677.592	0,33	ZAR 151.607.733	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	7.239.988	1,43
PLN 18.266.000	Republic of Poland Government Bond 2,5% 25/7/2027	4.003.543	0,79	ZAR 96.382.966	Republic of South Africa Government Bond 8,25% 31/3/2032*	4.358.264	0,86
PLN 15.943.000	Republic of Poland Government Bond 2,75% 25/4/2028	3.469.655	0,68	ZAR 109.015.480	Republic of South Africa Government Bond 8,5% 31/1/2037	4.450.408	0,88
PLN 33.708.000	Republic of Poland Government Bond 2,75% 25/10/2029*	7.083.701	1,40	ZAR 86.382.160	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 31/1/2044*	3.345.964	0,66
PLN 7.161.000	Republic of Poland Government Bond 3,25% 25/7/2025	1.673.528	0,33	ZAR 104.001.398	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 28/2/2048*	4.005.553	0,79
PLN 7.310.000	Republic of Poland Government Bond 3,75% 25/5/2027	1.682.191	0,33	ZAR 143.906.990	Republic of South Africa Government Bond 8,875% 28/2/2035	6.316.491	1,24
PLN 7.483.000	Republic of Poland Government Bond 6% 25/10/2033*	1.872.676	0,37	ZAR 64.791.804	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	2.641.929	0,52
PLN 16.192.000	Republic of Poland Government Bond 7,5% 25/7/2028	4.285.275	0,85	ZAR 106.300.806	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026	5.919.510	1,17
EUR 885.000	Republic of Poland Government International Bond 4,25% 14/2/2043	938.587	0,19			54.401.606	10,73
		37.576.188	7,41				
	Roumanie				Suède		
RON 6.665.000	Romania Government Bond 3,25% 24/6/2026	1.351.122	0,27	EUR 608.238	East Renewable 13,5% 1/1/2025	82.488	0,02
RON 6.135.000	Romania Government Bond 3,65% 28/7/2025	1.287.317	0,25				
RON 5.800.000	Romania Government Bond 3,65% 24/9/2031*	1.046.549	0,21				
RON 6.600.000	Romania Government Bond 4,15% 24/10/2030	1.253.843	0,25				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
États-Unis				Autres titres négociables			
USD 8.834.600	United States Treasury Note/ Bond 0,375% 15/7/2024	8.459.487	1,67	OBLIGATIONS			
USD 2.670.000	United States Treasury Note/ Bond 2,125% 30/11/2024	2.569.249	0,51	Ghana			
USD 2.631.800	United States Treasury Note/ Bond 2,375% 15/8/2024	2.558.105	0,50	GHS 13.710.000	Ghana Treasury Note 17,6% 20/2/2023***,****	601.314	0,12
USD 5.255.100	United States Treasury Note/ Bond 4,63% 30/6/2025†	5.222.461	1,03	GHS 2.900.000	Republic of Ghana Government Bonds 20,75% 6/3/2023***,****	127.193	0,02
		18.809.302	3,71			728.507	0,14
Uruguay				Ukraine			
UYU 47.757.000	Uruguay Government International Bond 8,5% 15/3/2028	1.232.517	0,24	UAH 15.985.000	Ukraine Government International Bond 16% 24/5/2023***,****	433.585	0,09
Total des obligations		485.739.280	95,83	Total des obligations		1.162.092	0,23
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		485.739.280	95,83	Total des autres valeurs mobilières		1.162.092	0,23
				Total du portefeuille		486.901.372	96,06
				Autres éléments de l'actif net		19.983.625	3,94
				Total de l'actif net (USD)		506.884.997	100,00

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	2.015.400	USD	1.345.504	JP Morgan	13/9/2023	(39.593)
AUD	3.800.000	USD	2.492.024	Bank of America	13/9/2023	(29.753)
BRL	25.900.000	USD	5.342.148	JP Morgan	5/9/2023	(86.077)
BRL	5.600.000	USD	1.148.021	HSBC Bank	5/9/2023	(11.573)
BRL	13.300.000	USD	2.703.736	BNP Paribas	5/9/2023	(4.672)
BRL	12.850.000	USD	2.563.540	Bank of America	5/9/2023	44.202
BRL	165.849	USD	33.846	Goldman Sachs	5/9/2023	(189)
CAD	3.031.400	USD	2.272.080	BNY Mellon	13/9/2023	(31.031)
CAD	3.400.000	USD	2.583.763	Bank of America	13/9/2023	(70.216)
CAD	2.300.000	USD	1.724.301	BNP Paribas	13/9/2023	(23.960)
CHF	797.500	USD	925.983	BNP Paribas	13/9/2023	(22.142)
CLP	2.115.336.744	USD	2.562.360	Morgan Stanley	13/9/2023	(89.228)
CLP	3.715.120.800	USD	4.551.860	Bank of America	13/9/2023	(208.353)
CLP	1.402.244.256	USD	1.714.801	Barclays	13/9/2023	(75.377)
CLP	1.067.400.000	USD	1.287.824	BNP Paribas	13/9/2023	(39.881)
CLP	2.066.356.000	USD	2.450.911	Goldman Sachs	13/9/2023	(35.045)
CNH	168.654.439	USD	23.397.749	Bank of America	13/9/2023	(205.335)
CNH	2.200.000	USD	307.865	Morgan Stanley	13/9/2023	(5.333)
CNH	4.000.000	USD	558.018	JP Morgan	13/9/2023	(7.960)
CNH	8.400.000	USD	1.162.962	BNP Paribas	13/9/2023	(7.841)
CNY	7.500.000	USD	1.047.175	BNY Mellon	13/9/2023	(14.944)
COP	15.104.950.878	USD	3.610.695	Morgan Stanley	13/9/2023	56.773
COP	26.848.350.000	USD	6.585.813	BNY Mellon	13/9/2023	(67.057)
COP	4.129.000.000	USD	965.795	Barclays	13/9/2023	36.723
COP	8.067.393.300	USD	1.900.006	BNP Paribas	13/9/2023	58.750
COP	1.555.198.822	USD	384.509	Deutsche Bank	13/9/2023	(6.908)
COP	5.610.400.000	USD	1.375.435	JP Morgan	13/9/2023	(13.235)
COP	6.428.700.000	USD	1.527.370	Bank of America	13/9/2023	33.513
CZK	188.201.293	USD	8.580.060	HSBC Bank	13/9/2023	(95.196)
CZK	24.132.500	USD	1.119.037	Morgan Stanley	13/9/2023	(31.048)
CZK	119.910.400	USD	5.467.789	JP Morgan	13/9/2023	(61.749)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
CZK	11.705.900	USD	538.611	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(10.863)
CZK	28.953.700	USD	1.327.766	Toronto-Dominion	13/9/2023	(22.418)
CZK	79.500.000	USD	3.615.720	Citigroup	13/9/2023	(31.544)
EUR	8.018.763	USD	8.816.180	Morgan Stanley	13/9/2023	(112.470)
EUR	18.689.300	USD	20.531.764	JP Morgan	13/9/2023	(246.060)
EUR	12.299.500	USD	13.523.851	HSBC Bank	13/9/2023	(173.752)
EUR	4.577.000	USD	4.965.331	Barclays	13/9/2023	2.628
EUR	4.664.000	USD	5.028.403	Bank of America	13/9/2023	33.987
GBP	2.047.200	USD	2.617.000	JP Morgan	13/9/2023	(21.761)
HUF	3.510.331.327	USD	9.864.638	Toronto-Dominion	13/9/2023	131.304
HUF	668.182.900	USD	1.870.718	Goldman Sachs	13/9/2023	31.985
HUF	1.308.051.700	USD	3.731.795	JP Morgan	13/9/2023	(7.015)
HUF	112.048.700	USD	321.983	Barclays	13/9/2023	(2.916)
HUF	461.002.100	USD	1.331.391	Citibank	13/9/2023	(18.652)
HUF	1.422.871.300	USD	4.017.039	BNP Paribas	13/9/2023	34.698
IDR	45.032.697.361	USD	2.972.654	Bank of America	13/9/2023	(16.122)
IDR	92.609.505.815	USD	6.133.234	HSBC Bank	13/9/2023	(53.140)
IDR	25.220.915.795	USD	1.667.059	BNP Paribas	13/9/2023	(11.230)
IDR	15.088.300.000	USD	1.005.417	JP Morgan	13/9/2023	(14.825)
ILS	7.861.200	USD	2.128.500	UBS	13/9/2023	(65.916)
ILS	1.627.800	USD	450.348	JP Morgan	13/9/2023	(23.254)
ILS	3.100.000	USD	841.976	Morgan Stanley	13/9/2023	(28.613)
INR	106.930.000	USD	1.289.362	UBS	13/9/2023	2.251
INR	832.727.994	USD	10.073.526	Morgan Stanley	13/9/2023	(14.964)
INR	140.600.000	USD	1.700.909	BNP Paribas	13/9/2023	(2.595)
INR	92.837.000	USD	1.119.779	JP Morgan	13/9/2023	1.603
JPY	3.635.228.018	USD	25.526.141	Morgan Stanley	13/9/2023	(617.836)
JPY	164.300.000	USD	1.191.416	JP Morgan	13/9/2023	(65.645)
JPY	896.300.000	USD	6.475.220	Bank of America	13/9/2023	(333.841)
KZT	532.957.500	USD	1.149.234	JP Morgan	31/10/2023	(6.146)
MXN	40.139.300	USD	2.306.867	Barclays	13/9/2023	87.844
MXN	37.807.100	USD	2.221.809	Morgan Stanley	13/9/2023	33.762
MXN	83.490.200	USD	4.877.409	Deutsche Bank	13/9/2023	103.617
MXN	4.804.400	USD	281.248	JP Morgan	13/9/2023	5.382
MXN	47.980.000	USD	2.815.442	BNY Mellon	13/9/2023	47.045
MXN	22.400.000	USD	1.284.589	Goldman Sachs	13/9/2023	51.795
MYR	18.901.503	USD	4.087.623	Morgan Stanley	13/9/2023	(11.388)
MYR	3.693.100	USD	790.052	State Street	13/9/2023	6.389
MYR	56.240.660	USD	12.105.179	Goldman Sachs	13/9/2023	23.498
NGN	1.052.800.000	USD	1.442.192	Standard Chartered Bank	18/9/2023	(87.327)
NOK	35.143.400	USD	3.295.521	State Street	13/9/2023	5.617
NOK	14.282.100	USD	1.338.649	Deutsche Bank	13/9/2023	2.917
NZD	4.200.000	USD	2.618.847	Morgan Stanley	13/9/2023	(120.845)
PEN	17.230.900	USD	4.721.062	Bank of America	13/9/2023	(50.043)
PEN	7.895.800	USD	2.191.439	Morgan Stanley	13/9/2023	(51.015)
PEN	4.000.000	USD	1.088.643	JP Morgan	13/9/2023	(4.307)
PHP	124.017.000	USD	2.243.016	JP Morgan	13/9/2023	(53.182)
PHP	85.800.000	USD	1.562.386	BNP Paribas	13/9/2023	(47.370)
PLN	57.060.808	USD	13.840.640	Bank of America	13/9/2023	5.264
PLN	8.182.200	USD	2.015.635	Goldman Sachs	13/9/2023	(30.210)
PLN	10.400.000	USD	2.620.255	Citigroup	13/9/2023	(96.677)
PLN	16.071.100	USD	3.995.463	Morgan Stanley	13/9/2023	(95.783)
PLN	9.109.000	USD	2.205.622	Deutsche Bank	13/9/2023	4.692
RON	11.642.900	USD	2.606.879	Deutsche Bank	13/9/2023	(50.618)
RON	18.422.300	USD	4.073.953	BNP Paribas	13/9/2023	(29.238)
RON	750.000	USD	169.241	Barclays	13/9/2023	(4.574)
THB	1.922.460.000	USD	54.460.817	Standard Chartered Bank	13/9/2023	488.202
THB	63.515.900	USD	1.834.181	Goldman Sachs	13/9/2023	(18.728)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
THB	23.053.700	USD	673.437	UBS	13/9/2023	(14.501)
THB	90.671.000	USD	2.664.052	Morgan Stanley	13/9/2023	(72.433)
THB	51.700.000	USD	1.478.502	JP Morgan	13/9/2023	(778)
TRY	129.730.000	USD	4.862.600	UBS	29/9/2023	(79.653)
TWD	66.011.609	USD	2.114.754	HSBC Bank	13/9/2023	(41.754)
TWD	85.100.000	USD	2.711.590	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(39.146)
USD	2.738.221	TRY	70.030.000	UBS	29/9/2023	156.322
USD	982.240	THB	34.748.000	Barclays	13/9/2023	(10.951)
USD	5.633.613	MYR	26.059.244	Barclays	13/9/2023	13.763
USD	1.132.023	AUD	1.692.860	Deutsche Bank	13/9/2023	35.107
USD	2.466.741	JPY	350.753.400	JP Morgan	13/9/2023	63.405
USD	2.284.458	CAD	3.031.500	HSBC Bank	13/9/2023	43.335
USD	23.450.498	MXN	404.849.395	Bank of America	13/9/2023	(702.818)
USD	27.436.288	COP	116.055.499.283	Goldman Sachs	13/9/2023	(741.887)
USD	3.440.611	PHP	191.371.409	Standard Chartered Bank	13/9/2023	61.465
USD	6.120.352	CHF	5.449.500	Toronto-Dominion	13/9/2023	(55.798)
USD	10.076.647	PEN	36.915.796	JP Morgan	13/9/2023	69.369
USD	165.948	CLP	133.894.775	JP Morgan	13/9/2023	9.405
USD	20.772.257	ZAR	393.055.540	Morgan Stanley	13/9/2023	(129.505)
USD	23.040.981	EUR	21.040.900	HSBC Bank	13/9/2023	202.808
USD	10.444.644	RON	47.578.455	Goldman Sachs	13/9/2023	(1.462)
USD	31.174.365	JPY	4.350.099.700	Bank of America	13/9/2023	1.367.814
USD	2.573.988	HUF	915.719.000	BNP Paribas	13/9/2023	(33.594)
USD	902.132	GBP	705.071	Morgan Stanley	13/9/2023	8.313
USD	2.424.586	CHF	2.143.137	JP Morgan	13/9/2023	(4.322)
USD	6.108.321	RON	27.658.000	Société Générale	13/9/2023	35.858
USD	5.033.438	EUR	4.572.000	Westpac	13/9/2023	70.907
USD	1.022.629	AUD	1.537.689	Goldman Sachs	13/9/2023	26.259
USD	803.817	CAD	1.067.411	Standard Chartered Bank	13/9/2023	14.703
USD	5.035.551	CZK	110.526.000	Citigroup	13/9/2023	52.598
USD	4.215.451	COP	17.277.850.000	Bank of America	13/9/2023	20.403
USD	5.872.159	CNH	42.567.000	JP Morgan	13/9/2023	18.583
USD	9.295.900	CZK	202.960.900	Deutsche Bank	13/9/2023	145.614
USD	3.348.988	THB	115.808.000	Morgan Stanley	13/9/2023	38.887
USD	3.522.021	TWD	109.917.000	Standard Chartered Bank	13/9/2023	70.236
USD	1.460.516	HUF	513.994.818	Morgan Stanley	13/9/2023	(3.124)
USD	10.247.749	HUF	3.617.892.082	Citigroup	13/9/2023	(54.481)
USD	3.191.348	ZAR	59.988.000	Citigroup	13/9/2023	1.329
USD	10.113.991	EUR	9.154.300	Goldman Sachs	13/9/2023	177.748
USD	5.498.779	HUF	1.918.323.900	JP Morgan	13/9/2023	36.202
USD	4.307.941	ZAR	80.670.200	JP Morgan	13/9/2023	18.091
USD	5.235.692	PLN	21.196.700	Goldman Sachs	13/9/2023	92.276
USD	3.121.317	IDR	47.159.978.900	Deutsche Bank	13/9/2023	25.122
USD	4.856.984	NOK	49.424.700	Deutsche Bank	13/9/2023	214.355
USD	4.316.053	ZAR	79.628.000	Deutsche Bank	13/9/2023	81.625
USD	4.209.857	HUF	1.479.263.200	Deutsche Bank	13/9/2023	(2.459)
USD	2.396.447	INR	197.395.900	JP Morgan	13/9/2023	12.093
USD	15.416	INR	1.266.968	HSBC Bank	13/9/2023	112
USD	1.313.009	PHP	72.163.000	Morgan Stanley	13/9/2023	38.789
USD	2.687.292	IDR	40.432.360.500	JP Morgan	13/9/2023	32.786
USD	291.590	IDR	4.361.430.000	Bank of America	13/9/2023	5.249
USD	3.754.423	INR	308.533.032	BNP Paribas	13/9/2023	27.638
USD	200.953	EUR	180.000	BNY Mellon	13/9/2023	5.578
USD	109.759	THB	3.770.000	Goldman Sachs	13/9/2023	2.002
USD	1.568.652	MYR	7.256.356	Morgan Stanley	13/9/2023	3.770
USD	3.187.268	ZAR	58.788.100	Standard Chartered Bank	13/9/2023	61.056
USD	883.035	NZD	1.390.000	Barclays	13/9/2023	56.316

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	102.361	CNH	730.000	Goldman Sachs	13/9/2023	1.976
USD	2.087.091	COP	8.698.995.700	Morgan Stanley	13/9/2023	(25.018)
USD	8.044.377	EUR	7.301.000	JP Morgan	13/9/2023	119.739
USD	4.560.147	PLN	18.264.900	Toronto-Dominion	13/9/2023	128.137
USD	1.537.496	PEN	5.550.000	Morgan Stanley	13/9/2023	32.981
USD	2.245.026	PLN	8.900.000	Société Générale	13/9/2023	85.425
USD	2.579.120	CZK	54.900.000	Goldman Sachs	13/9/2023	104.009
USD	3.784.426	MXN	64.810.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(82.139)
USD	3.682.648	COP	14.883.131.000	Barclays	13/9/2023	69.036
USD	3.127.859	MXN	53.547.400	Goldman Sachs	13/9/2023	(66.779)
USD	811.110	ZAR	14.285.700	Goldman Sachs	13/9/2023	51.430
USD	11.651.812	BRL	56.560.849	JP Morgan	5/9/2023	173.517
USD	909.317	IDR	13.727.047.545	HSBC Bank	13/9/2023	8.095
USD	1.566.820	EGP	54.400.000	Goldman Sachs	31/1/2024	7.056
USD	3.821.120	PLN	15.500.000	Bank of America	13/9/2023	60.018
USD	802.690	RON	3.610.000	UBS	13/9/2023	10.095
USD	2.251.584	MXN	38.100.000	JP Morgan	13/9/2023	(21.462)
USD	1.059.155	MXN	18.010.000	State Street	13/9/2023	(15.322)
USD	2.612.684	PLN	10.600.000	BNP Paribas	13/9/2023	40.576
USD	1.477.348	IDR	22.517.737.242	Barclays	13/9/2023	(1.009)
USD	171.308	BRL	840.076	Morgan Stanley	5/9/2023	825
USD	84.609	BRL	414.924	HSBC Bank	5/9/2023	406
USD	2.554.379	PLN	10.400.000	Deutsche Bank	13/9/2023	30.801
USD	5.205.372	PLN	21.100.000	Citigroup	13/9/2023	85.421
USD	5.073.347	EUR	4.600.000	Barclays	13/9/2023	80.424
USD	1.036.595	CZK	22.900.000	BNP Paribas	13/9/2023	4.172
USD	2.201.706	RON	9.959.400	Deutsche Bank	13/9/2023	15.066
USD	1.533.333	EGP	55.200.000	Goldman Sachs	7/2/2024	(39.137)
USD	1.327.888	COP	5.437.700.000	JP Morgan	13/9/2023	7.619
USD	2.416.830	PEN	9.006.000	Bank of America	13/9/2023	(24.552)
USD	1.215.458	CLP	1.051.247.332	BNP Paribas	13/9/2023	(13.601)
USD	411.666	CLP	354.476.795	Morgan Stanley	13/9/2023	(2.768)
USD	1.060.403	TRY	29.567.660	HSBC Bank	29/9/2023	(29.711)
USD	2.485.020	GBP	1.951.000	JP Morgan	13/9/2023	11.733
USD	1.353.998	ZAR	25.767.000	State Street	13/9/2023	(16.230)
USD	251.339	CLP	217.802.873	Bank of America	13/9/2023	(3.304)
USD	2.758.437	THB	97.428.000	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(26.314)
USD	2.423.911	NZD	4.084.000	Morgan Stanley	13/9/2023	(5.098)
USD	2.410.395	AUD	3.759.000	HSBC Bank	13/9/2023	(25.310)
USD	1.512.386	CZK	33.364.000	Morgan Stanley	13/9/2023	8.204
USD	602.239	ZAR	11.275.000	Royal Bank of Canada	13/9/2023	2.661
USD	33.697	BRL	165.849	Goldman Sachs	3/10/2023	193
ZAR	23.805.800	USD	1.261.602	Deutsche Bank	13/9/2023	4.334
ZAR	91.611.955	USD	4.880.409	JP Morgan	13/9/2023	(8.702)
ZAR	126.004.345	USD	6.898.288	Morgan Stanley	13/9/2023	(197.674)
ZAR	12.610.000	USD	695.263	RBS	13/9/2023	(24.693)
ZAR	27.330.000	USD	1.468.827	State Street	13/9/2023	(15.483)
ZAR	128.200.000	USD	6.990.415	Standard Chartered Bank	13/9/2023	(173.042)
ZAR	3.980.000	USD	209.820	Citigroup	13/9/2023	1.827
Moins-value nette non réalisée						(845.085)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	4.449	USD	5.094	BNY Mellon	15/9/2023	(50)
USD	110	CHF	97	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(50)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	6.878.969	USD	7.547.506	BNY Mellon	15/9/2023	(80.182)
USD	3.506.438	EUR	3.213.093	BNY Mellon	15/9/2023	18.540
Moins-value nette non réalisée						(61.642)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 812.923.767)						(906.777)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
74	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	8.205.906	62.649
29	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	3.097.336	18.352
Total				11.303.242	81.001

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	BRL 9.076.504	Fund receives Fixed 12,97%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	163.927	163.927
IRS	MXN 40.176.068	Fund receives Fixed 9,29%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	17/2/2028	24.530	24.530
IRS	THB 60.909.144	Fund receives Fixed 2,201%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	15/3/2028	(25.125)	(25.125)
IRS	THB 118.314.837	Fund receives Fixed 2,5207%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	15/3/2028	(2.509)	(2.509)
IRS	MXN 15.683.007	Fund receives Fixed 8,215%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	7/7/2028	(26.667)	(26.667)
IRS	THB 87.801.207	Fund receives Fixed 2,258%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	20/9/2028	(37.374)	(37.374)
IRS	THB 53.758.012	Fund receives Fixed 2,476%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	20/9/2028	(7.195)	(7.195)
IRS	CZK 45.806.422	Fund receives Fixed 4,391%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	14.752	14.752
IRS	CZK 39.634.566	Fund receives Fixed 4,434%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	16.246	16.246
IRS	CZK 63.790.799	Fund receives Fixed 4,77%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	69.926	69.926
IRS	CZK 51.450.997	Fund receives Fixed 4,8%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	59.553	59.553
IRS	CZK 45.838.379	Fund receives Fixed 4,88%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	60.546	60.546
IRS	CZK 54.564.944	Fund receives Fixed 4,96%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	80.989	80.989
IRS	THB 309.484.987	Fund receives Fixed 2,837%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	15/3/2033	(15.275)	(15.275)
IRS	THB 26.911.738	Fund receives Fixed 2,84%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	15/3/2033	(1.135)	(1.135)
IRS	THB 45.122.806	Fund receives Fixed 2,61%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	20/9/2033	(30.806)	(30.806)
IRS	THB 41.324.930	Fund receives Fixed 2,6475%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	20/9/2033	(24.349)	(24.349)
IRS	THB 33.465.226	Fund receives Fixed 2,7%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	20/9/2033	(15.337)	(15.337)
IRS	THB 113.018.128	Fund receives Fixed 2,725%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	20/9/2033	(44.752)	(44.752)
IRS	THB 58.530.000	Fund receives Fixed 2,78%; and pays Floating THB BKIBOR 1 Day	Bank of America	20/9/2033	(15.150)	(15.150)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	BRL 12.112.727	Fund receives Fixed 12,51%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	173.306	173.306
IRS	BRL 4.194.124	Fund receives Fixed 11,3675%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2029	27.338	27.338
IRS	BRL 4.544.118	Fund receives Fixed 12,74%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2029	100.492	100.492
IRS	BRL 11.801.902	Fund receives Fixed 11,985%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	117.196	117.196
IRS	BRL 17.431.440	Fund receives Fixed 12,78%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	287.014	287.014
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 56.817.862)					950.141	950.141

IRS: Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
46.200.000	Put	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1,09	29/9/2023	274.156	476.381
48.800.000	Call	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 5,45	31/10/2023	(122.630)	118.685
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 32.663.229)						151.526	595.066

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Energy Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Irlande				Espagne			
960.420	BlackRock ICS US Dollar Ultra Short Bond Fund*	111.275.888	1,61	6.700.575	EDP Renovaveis*	123.440.471	1,78
Total des Compartiments				Suède			
				7.857.797	Atlas Copco*	104.873.949	1,51
				Suisse			
				368.988	Sika*	104.863.038	1,51
				660.213	TE Connectivity	87.748.910	1,27
				Royaume-Uni			
				9.408.069	ITM Power*	10.552.247	0,15
				663.737	Spirax-Sarco Engineering	85.526.908	1,24
				États-Unis			
				Canada			
3.443.336	Canadian Solar	98.135.076	1,41	350.135	Albemarle*	69.624.345	1,00
				1.161.801	Analog Devices	211.598.816	3,05
				457.003	ANSYS*	145.098.452	2,09
				626.712	Autodesk	139.355.680	2,01
				609.421	Cadence Design Systems	147.150.795	2,12
				1.737.026	Darling Ingredients*	109.432.638	1,58
				756.641	First Solar	142.694.926	2,06
				2.272.395	Ingersoll Rand*	158.840.410	2,29
				6.448.350	NextEra Energy*	435.457.076	6,28
				637.048	ON Semiconductor*	63.195.162	0,91
				517.871	Quanta Services	109.685.078	1,58
				255.629	Rogers*	36.823.357	0,53
				5.090.036	Sunnova Energy International*	71.515.006	1,03
				3.056.994	Sunrun*	48.208.795	0,69
				632.610	Texas Instruments	107.170.460	1,54
				700.608	Union Pacific	155.892.286	2,25
						2.151.743.282	31,01
				Total des actions ordinaires		6.756.200.849	97,35
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
						6.867.476.737	98,96
				Autres titres négociables			
				ACTIONS ORDINAIRES			
				États-Unis			
				3.281.600	Enchi**	-	0,00
				Total des actions ordinaires		-	0,00
				OBLIGATIONS			
				États-Unis			
				USD 708.487	Enchi 0% 5/8/2020**,*	-	0,00
				Total des obligations		-	0,00
				Total des autres valeurs mobilières		-	0,00
				Total du portefeuille		6.867.476.737	98,96
				Autres éléments de l'actif net		72.381.173	1,04
				Total de l'actif net (USD)		6.939.857.910	100,00
Chine							
76.540.000	China Longyuan Power	60.603.696	0,87				
4.127.459	Contemporary Amperex Technology	134.199.750	1,94				
18.227.546	Shanghai Putailai New Energy Technology	81.976.144	1,18				
						276.779.590	3,99
Danemark							
874.818	Orsted*	56.182.111	0,81				
8.272.910	Vestas Wind Systems	192.284.070	2,77				
						248.466.181	3,58
France							
1.163.053	Air Liquide*	212.419.627	3,06				
3.371.069	Dassault Systemes*	134.227.505	1,93				
1.176.039	McPhy Energy*	8.657.239	0,13				
817.984	Schneider Electric	141.533.370	2,04				
						496.837.741	7,16
Allemagne							
5.519.616	Infineon Technologies*	198.578.030	2,86				
9.323.936	RWE	387.441.262	5,58				
						586.019.292	8,44
Irlande							
696.890	Eaton	161.127.937	2,32				
2.345.099	Johnson Controls International	139.064.371	2,00				
1.892.014	Kingspan	159.702.515	2,30				
547.900	Linde	213.028.999	3,07				
596.973	Trane Technologies	123.048.075	1,77				
						795.971.897	11,46
Italie							
57.501.656	Enel*	389.040.013	5,60				
2.315.477	Prysmian*	95.487.419	1,38				
						484.527.432	6,98
Japon							
1.381.900	Rohm*	115.067.745	1,66				
Pays-Bas							
209.199	ASML*	139.336.549	2,01				
4.386.776	STMicroelectronics	209.104.752	3,01				
						348.441.301	5,02
Portugal							
52.370.343	EDP - Energias de Portugal*	240.685.087	3,47				
Corée du Sud							
438.632	LG Chem	193.472.634	2,79				
437.099	Samsung SDI	203.048.068	2,92				
						396.520.702	5,71

* Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Sustainable Energy Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	6.990.090	USD	4.537.983	BNY Mellon	15/9/2023	(8.306)
USD	369.271	AUD	573.587	BNY Mellon	15/9/2023	(2.419)
Moins-value nette non réalisée						(10.725)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	1.967.483	USD	1.462.768	BNY Mellon	15/9/2023	(8.202)
USD	92.507	CAD	124.906	BNY Mellon	15/9/2023	162
Moins-value nette non réalisée						(8.040)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	162.043.543	USD	22.451.309	BNY Mellon	15/9/2023	(165.589)
USD	2.453.543	CNY	17.846.476	BNY Mellon	15/9/2023	(859)
Moins-value nette non réalisée						(166.448)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	164.141.463	USD	180.011.713	BNY Mellon	15/9/2023	(1.831.370)
USD	12.671.443	EUR	11.616.821	BNY Mellon	15/9/2023	61.079
Moins-value nette non réalisée						(1.770.291)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	2.832.990	USD	3.604.039	BNY Mellon	15/9/2023	(12.618)
USD	227.206	GBP	178.879	BNY Mellon	15/9/2023	438
Moins-value nette non réalisée						(12.180)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	91.198.691	USD	11.684.024	BNY Mellon	15/9/2023	(49.685)
USD	831.896	HKD	6.507.838	BNY Mellon	15/9/2023	1.684
Moins-value nette non réalisée						(48.001)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	320.428	USD	193.504	BNY Mellon	15/9/2023	(2.925)
USD	12.239	NZD	20.549	BNY Mellon	15/9/2023	18
Moins-value nette non réalisée						(2.907)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	1.121	SGD	1.518	BNY Mellon	5/9/2023	(2)
SGD	104.025.207	USD	77.271.168	BNY Mellon	15/9/2023	(274.581)
USD	5.628.200	SGD	7.620.843	BNY Mellon	15/9/2023	(12.523)
Moins-value nette non réalisée						(287.106)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 320.887.124)						(2.305.698)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Services aux collectivités	24,39
Technologie	23,19
Valeurs industrielles	22,01
Matériaux de base	11,63
Énergie	8,11
Biens de consommation non cyclique	3,16
Communications	2,92
Biens de consommation cyclique	1,94
Fonds d'investissement	1,61
Autres éléments de l'actif net	1,04
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Irlande				Panama			
5.814	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF ⁻	238.520	0,05	620	Carnival	9.035	0,00
Luxembourg				Espagne			
190.000	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund [†]	1.924.613	0,38	1.463	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria*	10.747	0,00
Total des Compartiments				Suède			
				290	ABB	10.199	0,00
				18	Swisscom	10.132	0,00
				Suisse			
				20.331			
				Taiwan			
				217	Taiwan Semiconductor Manufacturing	18.775	0,00
ACTIONS ORDINAIRES ET WARRANTS				Royaume-Uni			
Belgique				70.088	Barclays [†]	121.706	0,02
2.163	Azelis	43.779	0,01	24.433	BP	140.011	0,03
Canada				38.054	Mobico	37.660	0,01
8.281	Enbridge	270.158	0,06	715	Rio Tinto	40.902	0,01
10.049	Lions Gate Entertainment	71.690	0,01	États-Unis			
				341.848			
				942	Activision Blizzard	79.879	0,02
Chine				21	Adobe	10.795	0,00
2.000	BYD	57.773	0,01	514	Advanced Micro Devices	50.881	0,01
Curaçao				1.121	Alphabet	142.410	0,03
312	Schlumberger	16.921	0,00	232	Applied Materials	32.492	0,01
France				33.130	Astra Space	8.077	0,00
308	Accor	10.232	0,01	1.343	Aurora Innovation (Wts 31/12/2028)	646	0,00
1.002	BNP Paribas	60.170	0,01	55	Autodesk	11.272	0,00
5	Hermes International	9.587	0,00	4	Booking	11.438	0,00
2.070	TotalEnergies*	120.432	0,02	53	Broadcom	44.540	0,01
205	Unibail-Rodamco-Westfield*	10.156	0,00	5.380	Cano Health (Wts 3/6/2026)	253	0,00
				6.399	Cano Health (Wts 6/7/2025)	301	0,00
				44	Caterpillar	11.466	0,00
Allemagne				223	Cisco Systems	11.774	0,00
1.090	Covestro	53.628	0,01	577	Constellation Brands	138.439	0,03
3.867	Fresenius*	114.927	0,02	27	Deere	10.303	0,00
1.041	Mercedes-Benz	70.695	0,02	3.765	Delta Air Lines	149.046	0,03
68	Siemens	9.475	0,00	92	Dexcom	8.735	0,00
				24.871	DiamondRock Hospitality*	186.141	0,03
				140	Edwards Lifesciences	10.010	0,00
				8.615	Element Solutions	165.162	0,03
Irlande				187	Eli Lilly	94.625	0,02
57	Eaton	12.147	0,01	14	Equinix	10.184	0,00
Italie				6.440	EVgo (Wts 15/9/2025)	3.440	0,00
2.201	UniCredit	50.084	0,01	182	First Solar	31.636	0,01
Japon				6.901	Ford Motor	77.282	0,02
34.400	Mitsubishi UFJ Financial*	252.408	0,05	4.302	Forestar	113.999	0,02
12.240	Mizuho Financial*	186.028	0,04	2.499	General Motors	77.254	0,02
5.840	Sumitomo Mitsui Financial*	246.055	0,05	9.445	Green Plains*	271.351	0,06
				535	HCA Healthcare	138.012	0,03
				1.616	Hilton Worldwide	223.600	0,04
				3.112	Informatica	59.949	0,01
Luxembourg				36	Intuitive Surgical	10.623	0,00
13.026	ADLER	6.656	0,00	247	KLA	114.184	0,02
3.665	HomeToGo (Wts 31/12/2025)	37	0,00	467	Lennar	51.183	0,01
				30	Lululemon Athletica	10.546	0,00
				1.064	M/I Homes*	95.784	0,02
				62	Marsh & McLennan	11.230	0,00
Pays-Bas				638	Meritage Homes	81.304	0,02
84	ASML	51.567	0,01	190	Microchip Technology	14.434	0,00
50	ASML	30.663	0,01	1.157	Micron Technology	74.926	0,02
794	ING Groep	10.508	0,00	35	Microsoft	10.615	0,00
76	NXP Semiconductors	14.449	0,00	2.706	Mr Cooper	141.268	0,03
				359	NVIDIA	164.516	0,03
				Norvège			
5.176	Equinor*	147.214	0,03				

[∞] Participation croisée d'un fonds à compartiments multiples et investissement dans le fonds d'une partie liée, pour de plus amples informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

[†] Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 249.199	Apidos CLO XV 6,598% 20/4/2031	228.836	0,05	USD 236.204	Palmer Square CLO 2018-1 6,602% 18/4/2031	216.895	0,04
USD 100.000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2022-FL2 7,16% 15/5/2037	91.525	0,02	USD 110.203	Parallel 2015-1 7,338% 20/7/2027	101.673	0,02
USD 250.000	Bain Capital Credit CLO 2021-3 8,707% 24/7/2034	220.159	0,04	USD 250.000	Pikes Peak CLO 1 6,787% 24/7/2031	228.971	0,05
USD 250.000	Ballyrock CLO 2020-2 1 1,738% 20/10/2031	220.524	0,04	USD 250.000	Pikes Peak CLO 4 8,82% 15/7/2034	227.367	0,04
USD 250.000	Bardot CLO 8,607% 22/10/2032	225.698	0,04	USD 435.208	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4% 24/8/2040	359.498	0,07
USD 233.257	Barings CLO 2015-II 6,778% 20/10/2030	214.445	0,04	USD 250.000	Regatta IX Funding 7,37% 17/4/2030	230.188	0,05
USD 200.490	BlueMountain CLO 2013-2 6,787% 22/10/2030	184.159	0,04	USD 250.000	Regatta IX Funding 8,02% 17/4/2030	231.817	0,05
USD 230.383	Carbone CLO 6,728% 20/1/2031	212.080	0,04	USD 250.000	Regatta VIII Funding 7,27% 17/10/2030	230.448	0,05
USD 235.438	CARLYLE US CLO 2017-4 6,75% 15/1/2030	216.521	0,04	USD 250.000	Regatta VIII Funding 8,77% 17/10/2030	227.994	0,04
USD 300.472	CBAM 2017-1 6,838% 20/7/2030	276.836	0,05	USD 493.297	Rockford Tower CLO 2017-3 6,778% 20/10/2030	454.106	0,09
USD 250.000	CBAM 2017-1 7,988% 20/7/2030	228.585	0,05	USD 250.000	RR 19 12,07% 15/10/2035	231.541	0,05
USD 250.000	CIFC Funding 2013-I 7,32% 16/7/2030	229.660	0,05	USD 74.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	71.668	0,02
USD 250.000	CIFC Funding 2013-III-R 7,457% 24/4/2031	225.989	0,04	USD 71.000	Seagate HDD Cayman 8,5% 15/7/2031	68.602	0,01
USD 250.000	CIFC Funding 2014-II-R 8,407% 24/4/2030	228.154	0,05	USD 115.000	Seagate HDD Cayman 9,625% 1/12/2032	117.516	0,02
USD 250.000	CIFC Funding 2017-I 7,295% 23/4/2029	229.760	0,05	USD 250.000	Silver Creek CLO 8,938% 20/7/2030	229.560	0,05
USD 242.173	CIFC Funding 2017-II 6,538% 20/4/2030	222.378	0,04	USD 107.000	Strata CLO I 0% 15/1/2118	46.094	0,01
USD 370.000	CIFC Funding 2018-II 6,628% 20/4/2031	339.580	0,07	USD 100.000	Strata CLO I 12,65% 15/1/2031	87.082	0,02
USD 495.084	Dryden 53 CLO 6,69% 15/1/2031	455.140	0,09	USD 226.056	TICP CLO IX 6,728% 20/1/2031	207.843	0,04
USD 278.210	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 6,833% 15/8/2030	255.802	0,05	USD 150.000	TRINITAS CLO IV 6,972% 18/10/2031	135.707	0,03
USD 200.000	Fantasia 7,95% 5/7/2022***	8.837	0,00	USD 250.000	Trinitas CLO XIV 7,613% 25/1/2034	227.779	0,04
USD 410.000	Fantasia 11,75% 17/4/2022***	18.895	0,01	USD 250.000	Trinitas CLO XIV 8,613% 25/1/2034	229.953	0,05
USD 262.000	Gaci First Investment 4,75% 14/2/2030	234.756	0,05	USD 250.000	Voya CLO 2016-1 8,238% 20/1/2031	201.847	0,04
USD 263.000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	239.737	0,05			15.933.474	3,14
USD 250.000	Galaxy XXII CLO 6,77% 16/4/2034	227.337	0,04	Chili			
USD 250.000	Goldentree Loan Opportunities X 6,708% 20/7/2031	229.975	0,04	USD 200.000	Chile Government International Bond 4,34% 7/3/2042*	158.539	0,03
USD 500.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 10,938% 20/10/2034	433.903	0,09	USD 200.000	Empresa Nacional del Petroleo 3,75% 5/8/2026	173.416	0,03
USD 510.000	Golub Capital Partners CLO 55B 12,148% 20/7/2034	472.611	0,09			331.955	0,06
USD 200.000	iQIYI 6,5% 15/3/2028	162.681	0,03	Colombie			
USD 283.896	Loanpal Solar Loan 2021-1 2,29% 20/1/2048	193.591	0,04	USD 200.000	Colombia Government International Bond 3,125% 15/4/2031	142.173	0,03
USD 135.192	Madison Park Funding XLI 6,437% 22/4/2027	124.198	0,02	USD 200.000	Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	170.121	0,03
USD 200.000	MAF Global 6,375% 20/3/2026	179.422	0,03	USD 200.000	Colombia Government International Bond 4,5% 28/1/2026	177.906	0,04
USD 250.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 7,076% 20/1/2035	227.334	0,04	USD 747.000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033*	711.759	0,14
USD 250.000	OCP CLO 2014-5 8,512% 26/4/2031	212.282	0,04	COP 2.865.600.000	Colombian TES 5,75% 3/11/2027	553.698	0,11
USD 250.000	OCP CLO 2014-7 7,238% 20/7/2029	229.641	0,05	COP 2.242.400.000	Colombian TES 6,25% 26/11/2025	470.947	0,09
USD 198.546	OHA Loan Funding 2013-2 6,679% 23/5/2031	181.858	0,04	COP 3.677.000.000	Colombian TES 7,5% 26/8/2026	777.666	0,15
USD 250.000	OZLM VIII 8,72% 17/10/2029	230.412	0,05	USD 130.000	Ecopetrol 4,125% 16/1/2025	116.101	0,02
				USD 61.000	Ecopetrol 5,875% 28/5/2045	39.323	0,01
				USD 531.000	Ecopetrol 6,875% 29/4/2030	455.288	0,09
				USD 251.000	Ecopetrol 8,875% 13/1/2033*	234.240	0,05

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 15.560	FCT Autonomia 2019 5,242% 25/9/2035	15.498	0,00	EUR 100.000	E.ON 3,5% 26/10/2037	93.004	0,02
EUR 310.000	Forvia 3,75% 15/6/2028*	283.893	0,06	EUR 500.000	Eurogrid 1,113% 15/5/2032	402.405	0,08
EUR 169.000	Goldstory 5,375% 1/3/2026	163.384	0,03	EUR 100.000	FCT Autonomia DE 2023 4,792% 26/1/2043	99.839	0,02
EUR 100.000	Goldstory 8,97% 1/3/2026	101.348	0,02	EUR 200.000	Fresenius 4,25% 28/5/2026	200.088	0,04
EUR 200.000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 4,734% 27/5/2061	196.712	0,04	EUR 100.000	Gruenthal 3,625% 15/11/2026	95.026	0,02
EUR 289.000	Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0,625% 16/9/2028	239.741	0,05	EUR 117.000	Gruenthal 4,125% 15/5/2028	109.499	0,02
EUR 200.000	iliad 5,375% 14/6/2027	198.506	0,04	EUR 400.000	Heidelberg Materials 3,75% 31/5/2032	378.522	0,07
EUR 200.000	iliad 5,625% 15/2/2030	194.800	0,04	EUR 200.000	HT Troplast 9,375% 15/7/2028	200.722	0,04
EUR 100.000	Iliad 5,125% 15/10/2026	96.318	0,02	EUR 100.000	IHO Verwaltungs 8,75% 15/5/2028	104.454	0,02
EUR 100.000	La Financiere Atalian 4% 15/5/2024	74.241	0,01	EUR 100.000	PCF 8,413% 15/4/2026	87.397	0,02
GBP 200.000	La Financiere Atalian 6,625% 15/5/2025	161.240	0,03	EUR 200.000	Renk/Frankfurt am Main 5,75% 15/7/2025	198.506	0,04
EUR 100.000	Loxam 3,75% 15/7/2026	94.221	0,02	EUR 300.000	Robert Bosch 4,375% 2/6/2043	299.916	0,06
EUR 100.000	Loxam 4,5% 15/4/2027	90.170	0,02	EUR 87.920	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	86.480	0,02
EUR 100.000	Picard Groupe 3,875% 1/7/2026	92.366	0,02	EUR 300.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	289.347	0,06
EUR 600.000	RCI Banque 2,625% 18/2/2030	564.750	0,11	EUR 160.000	Tele Columbus 3,875% 2/5/2025	102.664	0,02
EUR 135.000	RCI Banque 4,125% 1/12/2025	134.617	0,03	EUR 142.000	thyssenkrupp 2,875% 22/2/2024	140.719	0,03
EUR 75.000	RCI Banque 4,625% 13/7/2026	75.462	0,01	EUR 115.000	TK Elevator Midco 8,413% 15/7/2027	114.989	0,02
EUR 100.000	Societe Generale 1,125% 21/4/2026	94.846	0,02	EUR 100.000	ZF Finance 2% 6/5/2027	88.950	0,01
EUR 400.000	Societe Generale 4,25% 6/12/2030	388.300	0,08	EUR 100.000	ZF Finance 2,75% 25/5/2027	90.976	0,02
USD 240.000	Societe Generale 9,375% 22/11/2027	220.554	0,04	EUR 100.000	ZF Finance 3% 21/9/2025*	95.654	0,02
EUR 700.000	TotalEnergies 1,75% 4/4/2024	682.150	0,13	EUR 100.000	ZF Finance 3,75% 21/9/2028	90.946	0,02
EUR 100.000	TotalEnergies 2,625% 26/2/2025	95.351	0,02	EUR 100.000	ZF Finance 5,75% 3/8/2026	100.699	0,02
EUR 71.000	Vallourec 8,5% 30/6/2026	70.992	0,01			11.137.540	2,20
EUR 630	Worldline 0% 30/7/2025	68.804	0,01				
		14.281.112	2,82				
	Allemagne				Ghana		
USD 400.000	Allianz 3,2% 30/10/2027*	280.463	0,05	USD 247.000	Ghana Government International Bond 7,625% 16/5/2029	98.655	0,02
EUR 100.000	BASF 4,5% 8/3/2035	102.502	0,02				
EUR 280.000	Bayer 4% 26/8/2026*	283.140	0,05		Guatemala		
EUR 300.000	Bayer 4,5% 25/3/2082	285.296	0,05	USD 200.000	Guatemala Government Bond 3,7% 7/10/2033	149.148	0,03
EUR 103.000	Bayer 4,625% 26/5/2033	104.384	0,02	USD 101.000	Guatemala Government Bond 5,25% 10/8/2029	88.696	0,02
EUR 3.376.800	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0% 15/8/2030†	2.864.505	0,57			237.844	0,05
EUR 1.355.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,7% 15/8/2032*	1.275.394	0,25		Hongrie		
EUR 100.000	Cheplapharm Arzneimittel 3,5% 11/2/2027	91.013	0,02	USD 22.000	Hungary Government International Bond 5,375% 25/3/2024	20.243	0,00
EUR 100.000	Commerzbank 5,125% 18/1/2030	99.285	0,02				
EUR 200.000	Commerzbank 6,125% 9/10/2025	181.650	0,04		Indonésie		
GBP 200.000	Commerzbank 8,625% 28/2/2033	230.838	0,05	USD 200.000	Bank Negara Indonesia Persero 3,75% 30/3/2026	171.682	0,03
EUR 200.000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1,875% 15/10/2024	126.182	0,02	USD 400.000	Freeport Indonesia 4,763% 14/4/2027	355.741	0,07
EUR 500.000	Deutsche Bahn Finance 0,95% 22/1/2025	461.529	0,09	USD 400.000	Indonesia Government International Bond 6,75% 15/1/2044	422.753	0,08
EUR 100.000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	89.770	0,02	IDR 4.623.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,375% 15/8/2028	282.158	0,06
EUR 824.359	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,1% 15/4/2026	1.005.880	0,20	IDR 7.820.000.000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/2/2033	494.319	0,10
EUR 100.000	Deutsche Lufthansa 3,5% 14/7/2029	90.936	0,02	IDR 12.171.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2038	781.876	0,15
EUR 100.000	Deutsche Lufthansa 3,75% 11/2/2028	93.971	0,02	IDR 3.346.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029	221.025	0,04
				IDR 7.362.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2036	506.326	0,10
				IDR 2.184.000.000	Indonesia Treasury Bond 9% 15/3/2029	148.563	0,03

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,4% 6/6/2027	180.418	0,04	EUR 250.000	Harvest CLO XXIII 6,705% 20/10/2032	234.883	0,04
		3.564.861	0,70	EUR 277.920	Haus European Loan Conduit No 39 4,364% 28/7/2051	261.885	0,05
	International			EUR 448.870	Haus European Loan Conduit No 39 5,114% 28/7/2051	370.181	0,07
EUR 559.000	European Union 0% 4/10/2030	453.251	0,09	EUR 100.000	Henley CLO IV 5,071% 25/4/2034	96.645	0,02
EUR 6.379.000	European Union 0,3% 4/11/2050	3.005.275	0,59	EUR 250.000	Henley CLO IV 6,721% 25/4/2034	235.093	0,04
EUR 803.000	European Union 0,4% 4/2/2037	558.426	0,11	EUR 150.000	Henley CLO IV 8,971% 25/4/2034	138.914	0,03
EUR 24.000	European Union 2,5% 4/10/2052	19.959	0,00	EUR 100.000	Invesco Euro CLO III 5,413% 15/7/2032	96.511	0,02
EUR 48.000	European Union 2,625% 4/2/2048	42.455	0,01	EUR 234.664	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,687% 17/8/2033	212.713	0,04
EUR 97.600	European Union 3% 4/3/2053	90.057	0,02	EUR 577.879	Last Mile PE 2021 5,387% 17/8/2031	532.549	0,11
		4.169.423	0,82	EUR 250.000	Man GLG Euro CLO VI 7,163% 15/10/2032	237.935	0,05
	Irlande			EUR 140.000	Margay CLO I 5,8% 15/7/2036	141.103	0,03
USD 150.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 5,75% 6/6/2028	136.941	0,03	EUR 150.000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 9,183% 17/4/2034	140.147	0,03
GBP 299.888	Agora UK 2021 6,37% 22/7/2031	337.250	0,07	EUR 250.000	Northwoods Capital 19 Euro 6,326% 25/11/2033	242.149	0,05
EUR 400.000	AIB 5,25% 9/10/2024	376.200	0,07	EUR 250.000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 5,546% 21/1/2035	243.770	0,05
EUR 200.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2,125% 15/8/2026	178.595	0,04	EUR 100.000	OAK Hill European Credit Partners VI 4,905% 20/1/2032	97.456	0,02
GBP 300.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4,75% 15/7/2027	276.769	0,05	EUR 250.000	OCP Euro CLO 2019-3 6,005% 20/4/2033	241.497	0,05
USD 251.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5,25% 30/4/2025	226.143	0,04	EUR 250.000	OCP Euro CLO 2019-3 7,005% 20/4/2033	238.636	0,05
EUR 100.000	Ares European CLO VII 5,163% 15/10/2030	98.045	0,02	EUR 190.000	Palmer Square European CLO 2023-1 5,75% 15/7/2036	190.662	0,04
EUR 250.000	Ares European CLO X 6,463% 15/10/2031	237.641	0,04	EUR 150.000	Palmer Square European CLO 2023-1 10,05% 15/7/2036	152.613	0,03
EUR 199.623	Aurium CLO IV 4,393% 16/1/2031	196.580	0,04	EUR 575.873	Pearl Finance 2020 6,287% 17/11/2032	560.756	0,11
EUR 100.000	Aurium CLO VIII 4,418% 23/6/2034	97.437	0,02	EUR 250.000	Penta CLO 11 6,231% 15/11/2034	248.718	0,05
EUR 100.000	Avoca CLO XV 4,713% 15/4/2031	96.462	0,02	USD 142.140	Prodigy Finance CM2021-1 6,679% 25/7/2051	130.125	0,02
EUR 100.000	Avoca CLO XXII 4,963% 15/4/2035	96.031	0,02	USD 100.948	Prodigy Finance CM2021-1 7,929% 25/7/2051	92.273	0,02
EUR 400.000	Bank of Ireland 7,5% 19/5/2025	392.812	0,08	EUR 96.500	River Green Finance 2020 4,748% 22/1/2032	91.524	0,02
EUR 150.000	Bridgepoint CLO IV 5,905% 20/1/2037	150.560	0,03	EUR 250.000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 5,305% 20/1/2033	242.318	0,05
EUR 150.000	Capital Four CLO V 5,331% 25/4/2036	150.214	0,03	GBP 131.781	Scorpio European Loan Conduit No. 34 7,1% 17/5/2029	150.689	0,03
EUR 200.000	CIFC European Funding CLO II 5,263% 15/4/2033	195.198	0,04	USD 125.000	Shire Acquisitions Investments Ireland 3,2% 23/9/2026	108.110	0,02
EUR 100.000	CIFC European Funding CLO IV 4,61% 18/8/2035	97.274	0,02	GBP 189.959	Taurus 2019-2 UK 7,438% 17/11/2029	212.463	0,04
EUR 250.000	Clontarf Park CLO 6,772% 5/8/2030	249.912	0,05	GBP 222.367	Taurus 2021-1 UK 6,869% 17/5/2031	240.585	0,05
EUR 160.000	Contego CLO VI 4,453% 15/4/2034	156.114	0,03	GBP 604.323	Taurus 2021-4 UK 6,969% 17/8/2031	651.254	0,13
EUR 300.000	CRH SMW Finance 4% 11/7/2031	297.938	0,06	GBP 200.422	Taurus 2021-4 UK 7,319% 17/8/2031	215.181	0,04
EUR 250.000	CVC Cordatus Loan Fund 6,548% 20/5/2036	249.996	0,05	EUR 150.000	Tikehau CLO VII 5,705% 20/10/2035	150.346	0,03
EUR 100.000	CVC Cordatus Loan Fund IV 5,116% 22/2/2034	95.788	0,02	EUR 250.000	Voya Euro CLO II 5,813% 15/7/2035	237.142	0,04
EUR 250.000	Euro-Galaxy III CLO 6,948% 24/4/2034	241.649	0,05	EUR 100.000	Voya Euro CLO III 5,313% 15/4/2033	97.294	0,02
EUR 250.000	Fidelity Grand Harbour CLO 2021-1 7,263% 15/10/2034	233.414	0,04			12.646.932	2,50
EUR 150.000	Fidelity Grand Harbour CLO 2023-1 5,678% 15/8/2036	150.549	0,03				
EUR 100.000	Harvest CLO XVIII 4,863% 15/10/2030	97.300	0,02				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Île de Man				EUR 172.000	Telecom Italia 2,375% 12/10/2027*	150.065	0,03
USD 200.000	AngloGold Ashanti 3,75% 1/10/2030	153.335	0,03	EUR 100.000	Telecom Italia 4% 11/4/2024	99.479	0,02
Israël				EUR 200.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	202.247	0,04
USD 130.000	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033*	121.469	0,02	EUR 200.000	Telecom Italia 7,875% 31/7/2028	208.180	0,04
Italie				EUR 200.000	UniCredit 2,731% 15/1/2032	179.250	0,04
EUR 150.000	A2A 4,5% 19/9/2030	151.756	0,03	EUR 150.000	UniCredit 4,45% 16/2/2029	147.362	0,03
EUR 150.000	ASTM 1,5% 25/1/2030	122.536	0,02	USD 200.000	UniCredit 7,296% 2/4/2034	176.376	0,03
EUR 125.000	ASTM 2,375% 25/11/2033	97.560	0,02	9.916.079 1,96			
EUR 500.000	AutoFlorence 3 4,592% 25/12/2046	501.787	0,10	Jamaïque			
EUR 100.000	AutoFlorence 3 6,992% 25/12/2046	100.322	0,02	USD 200.000	Jamaica Government International Bond 6,75% 28/4/2028	190.674	0,04
EUR 100.000	AutoFlorence 3 8,992% 25/12/2046	100.521	0,02	Japon			
EUR 499.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	486.273	0,10	EUR 200.000	East Japan Railway 2,614% 8/9/2025	195.165	0,04
EUR 200.000	Azzurra Aeroporti 2,625% 30/5/2027	180.784	0,04	EUR 400.000	East Japan Railway 4,11% 22/2/2043	390.280	0,08
EUR 200.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6,75% 2/3/2026	200.954	0,04	USD 1.150.000	Honda Motor 2,271% 10/3/2025	1.012.352	0,20
EUR 200.000	Banco BPM 3,25% 14/1/2031	186.000	0,04	USD 1.300.000	Mizuho Financial 3,261% 22/5/2030	1.052.562	0,21
EUR 200.000	Banco BPM 3,375% 19/1/2032	177.750	0,03	USD 400.000	Rakuten 3,546% 27/11/2024*	341.492	0,07
EUR 100.000	Banco BPM 5% 14/9/2030	98.418	0,02	EUR 400.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	386.910	0,08
EUR 375.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	377.443	0,07	EUR 100.000	SoftBank 3,125% 19/9/2025	95.062	0,02
EUR 100.000	CA Auto Bank 0% 16/4/2024	97.519	0,02	EUR 100.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032	78.345	0,01
EUR 399.045	Cassia 2022-1 6,883% 22/5/2034	368.751	0,07	USD 200.000	SoftBank 4% 6/7/2026*	168.902	0,03
EUR 200.000	Castor 8,776% 15/2/2029	189.166	0,04	USD 1.054.000	Sumitomo Mitsui Financial 2,472% 14/1/2029	832.175	0,16
EUR 108.000	Cedacri Mergerco 8,424% 15/5/2028	105.604	0,02	USD 200.000	Takeda Pharmaceutical 2,05% 31/3/2030	151.592	0,03
EUR 200.000	Cedacri Mergerco 9,281% 15/5/2028	197.013	0,04	JPY 10.000.000	Tokyu 0% 29/9/2028	65.949	0,01
EUR 100.000	doValue 3,375% 31/7/2026	85.672	0,02	JPY 10.000.000	Tokyu 0% 30/9/2030	66.327	0,01
EUR 200.000	Enel 6,375% 16/4/2028*	204.450	0,04	4.837.113 0,95			
EUR 203.000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11,125% 15/5/2028	202.945	0,04	Jersey			
EUR 600.000	Eni 2,625% 13/10/2025	557.705	0,11	USD 100.000	Aptiv / Aptiv 2,396% 18/2/2025	87.740	0,02
EUR 211.000	Eni 4,25% 19/5/2033	209.776	0,04	USD 100.000	Aptiv / Aptiv 3,25% 1/3/2032	78.178	0,01
EUR 300.000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027	323.635	0,06	GBP 340.000	Galaxy Bidco 6,5% 31/7/2026	365.913	0,07
EUR 100.000	IMA Industria Macchine Automatiche 3,75% 15/1/2028	89.528	0,02	GBP 22.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 5,844% 5/11/2031	25.726	0,01
EUR 204.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,625% 21/10/2028	179.920	0,04	557.557 0,11			
EUR 100.000	Inter Media and Communication 6,75% 9/2/2027	96.730	0,02	Jordanie			
EUR 860.000	Intesa Sanpaolo 0,75% 4/12/2024	825.540	0,16	USD 200.000	Jordan Government International Bond 5,85% 7/7/2030	170.542	0,03
USD 200.000	Intesa Sanpaolo 5,017% 26/6/2024	180.251	0,04	Kenya			
EUR 160.000	Intesa Sanpaolo 5,125% 29/8/2031	162.369	0,03	USD 200.000	Republic of Kenya Government International Bond 8% 22/5/2032	153.234	0,03
GBP 315.000	Intesa Sanpaolo 5,148% 10/6/2030	308.993	0,06	Luxembourg			
EUR 389.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,5% 30/4/2045	234.463	0,05	EUR 210.000	Adler Financing 12,5% 30/6/2025	216.861	0,04
EUR 220.419	Koromo Italy 4,432% 26/2/2035	220.843	0,04	EUR 100.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3,625% 1/6/2028*	82.120	0,02
EUR 300.000	Nexi 0% 24/2/2028	234.715	0,05	EUR 100.000	Altice Financing 2,25% 15/1/2025	95.750	0,02
EUR 100.000	Poste Italiane 2,625% 24/3/2029	78.250	0,01	EUR 100.000	Altice Financing 4,25% 15/8/2029	76.479	0,01
EUR 71.298	Progetto Quinto 4,23% 27/10/2036	71.214	0,01	GBP 100.000	Aroundtown 4,75% 25/6/2024	45.614	0,01
EUR 402.361	Red & Black Auto Italy 6,482% 28/12/2031	392.729	0,08	USD 280.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	2.581	0,00
EUR 200.000	Rekeep 7,25% 1/2/2026*	186.143	0,04	USD 45.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	415	0,00
EUR 212.000	Telecom Italia 1,625% 18/1/2029	167.092	0,03	EUR 355.000	BL Consumer Credit 2021 6,492% 25/9/2038	349.364	0,07
				GBP 200.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	206.502	0,04
				USD 400.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	349.958	0,07
				EUR 100.000	Cullinan Holdco Scsp 4,625% 15/10/2026	83.867	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
EUR 200.000	Cullinan Holdco Scsp 8,413% 15/10/2026	187.273	0,04	USD 400.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	305.295	0,06
EUR 300.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	307.674	0,06	USD 200.000	Mexico Government International Bond 3,75% 11/1/2028	174.889	0,04
USD 250.000	EIG Pearl 4,387% 30/11/2046*	174.762	0,03			11.108.691	2,19
EUR 200.000	European TopSoho 4% 21/9/2021***	154.000	0,03				
EUR 251.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	194.490	0,04		Maroc		
GBP 200.000	Garfunkelux Holdco 3 7,75% 1/11/2025	178.437	0,03	USD 331.000	Morocco Government International Bond 6,5% 8/9/2033	307.121	0,06
EUR 134.000	Herens Midco 5,25% 15/5/2029	72.228	0,02		Pays-Bas		
USD 200.000	Kenbourne Invest 6,875% 26/11/2024	155.171	0,03	EUR 300.000	Abertis Infraestructuras Finance 3,248% 24/11/2025	272.415	0,05
USD 200.000	Kernel 6,5% 17/10/2024	131.926	0,03	EUR 200.000	ABN AMRO Bank 0,5% 23/9/2029	160.918	0,03
EUR 100.000	Kleopatra 2 6,5% 1/9/2026	62.921	0,01	EUR 600.000	ABN AMRO Bank 4,25% 21/2/2030	595.575	0,12
EUR 100.000	Lion/Polaris Lux 4 7,526% 1/7/2026	99.227	0,02	GBP 700.000	ABN AMRO Bank 5,25% 26/5/2026	805.184	0,16
USD 164.000	Medtronic Global 4,25% 30/3/2028	146.763	0,03	EUR 100.000	ABN AMRO Bank 5,5% 21/9/2033	99.614	0,02
USD 180.000	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028*	149.420	0,03	EUR 100.000	Ashland Services 2% 30/1/2028	86.363	0,02
USD 180.000	Millicom International Cellular 6,625% 15/10/2026	162.383	0,03	EUR 300.000	ATF Netherlands 7,078% 20/1/2024	134.190	0,03
USD 31.000	Puma International Financing 5,125% 6/10/2024	28.316	0,00	EUR 100.000	Axalta Coating Systems Dutch B 3,75% 15/1/2025	99.047	0,02
EUR 218.000	Rossini 6,75% 30/10/2025	219.907	0,04	EUR 290.000	BP Capital Markets 4,323% 12/5/2035	287.541	0,06
EUR 100.000	Rossini 7,589% 30/10/2025	100.244	0,02	USD 200.000	Braskem Netherlands Finance 7,25% 13/2/2033	175.403	0,03
EUR 300.000	SELP Finance 0,875% 27/5/2029	239.792	0,05	USD 200.000	Braskem Netherlands Finance 8,5% 23/1/2081	184.536	0,04
EUR 977.000	SES 2,875% 27/5/2026	852.091	0,17	EUR 700.000	Cooperatieve Rabobank 4% 10/1/2030	691.849	0,14
EUR 100.000	SES 5,625% 29/1/2024	100.070	0,02	EUR 100.000	Cooperatieve Rabobank 4,233% 25/4/2029	99.525	0,02
EUR 200.000	Stena International 7,25% 15/2/2028*	206.907	0,04	EUR 900.000	de Volksbank 2,375% 4/5/2027	848.700	0,17
EUR 200.000	Summer BC Holdco B 5,75% 31/10/2026	181.820	0,04	GBP 152.000	Deutsche Telekom International Finance 8,875% 27/11/2028*	203.646	0,04
USD 11.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	8.422	0,00	EUR 700.000	Digital Dutch Finco 0,625% 15/7/2025	646.531	0,13
USD 56.000	Telecom Italia Capital 6,375% 15/11/2033	45.159	0,01	EUR 134.310	Domi 2021-1 4,156% 15/6/2053	133.594	0,02
USD 213.000	Tupy Overseas 4,5% 16/2/2031	158.958	0,03	EUR 141.017	Domi 2023-1 4,901% 15/2/2055	142.038	0,03
		5.827.872	1,15	EUR 308.000	Dutch Property Finance 2021-2 4,764% 28/4/2059	297.334	0,06
	Îles Marshall			GBP 100.000	E.ON International Finance 6,375% 7/6/2032	121.317	0,02
USD 210.000	Danaos 8,5% 1/3/2028	196.053	0,04	EUR 100.000	Global Switch Finance 1,375% 7/10/2030	82.555	0,01
	Maurice			EUR 100.000	Heimstaden Bostad Treasury 1,375% 3/3/2027	79.297	0,01
USD 200.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	165.583	0,03	EUR 500.000	Iberdrola International 1,45% 9/11/2026	435.750	0,09
USD 250.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024	226.970	0,05	EUR 100.000	Iberdrola International 2,625% 26/12/2023	98.800	0,02
		392.553	0,08	EUR 100.000	Iberdrola International 3,25% 12/11/2024	97.650	0,02
	Mexique			EUR 200.000	ING Groep 1% 16/11/2032	167.951	0,03
USD 200.000	Banco Mercantil del Norte 5,875% 24/1/2027	162.783	0,03	EUR 600.000	ING Groep 2,125% 23/5/2026	578.100	0,11
USD 200.000	Braskem Idesa SAPI 6,99% 20/2/2032	110.021	0,02	GBP 100.000	ING Groep 3% 18/2/2026	108.601	0,02
USD 76.000	Grupo Posadas 5% 30/12/2027	60.079	0,01	EUR 300.000	ING Groep 5% 20/2/2035	292.701	0,06
USD 213.000	Metalsa Sapi 3,75% 4/5/2031	153.061	0,03	EUR 100.000	Koninklijke KPN 2% 8/11/2024	95.430	0,02
MXN 13.100.000	Mexican Bonos 7,5% 3/6/2027	672.157	0,13	USD 200.000	MEGlobal 2,625% 28/4/2028	162.805	0,03
MXN 19.473.100	Mexican Bonos 7,5% 26/5/2033	948.323	0,19	USD 200.000	MEGlobal 2,625% 28/4/2028	162.805	0,03
MXN 19.629.000	Mexican Bonos 7,75% 29/5/2031	984.218	0,19	USD 23.000	Mondelez International Netherlands 1,25% 24/9/2026	18.733	0,00
MXN 50.380.000	Mexican Bonos 8,5% 31/5/2029	2.665.198	0,53	EUR 200.000	Naturgy Finance 2,374% 23/11/2026	177.700	0,03
MXN 17.110.800	Mexican Bonos 8,5% 18/11/2038	871.367	0,17				
MXN 272.623.100	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	1.361.651	0,27				
MXN 90.973.800	Mexico Cetes 0% 3/10/2024	445.598	0,09				
MXN 455.000.000	Mexico Cetes 0% 28/11/2024	2.194.051	0,43				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Singapour				EUR 100.000	Food Service Project 5,5% 21/1/2027	95.441	0,02
USD 178.250	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027	153.409	0,03	EUR 100.000	Grupo Antolin-Irausa 3,5% 30/4/2028	74.103	0,01
USD 380.000	Pfizer Investment Enterprises 4,65% 19/5/2025	346.336	0,07	EUR 100.000	International Consolidated Airlines 3,75% 25/3/2029	87.495	0,02
USD 185.000	Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	167.964	0,03	EUR 100.000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	93.052	0,02
		667.709	0,13	EUR 2.359.000	Spain Government Bond 0,5% 30/4/2030	1.974.719	0,39
Afrique du Sud				EUR 10.301.000	Spain Government Bond 2,55% 31/10/2032	9.615.932	1,90
ZAR 6.099.746	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	268.486	0,05	EUR 2.379.000	Spain Government Bond 2,9% 31/10/2046	2.004.295	0,40
ZAR 2.733.508	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 31/1/2044	97.591	0,02	EUR 6.907.000	Spain Government Bond 3,15% 30/4/2033	6.735.258	1,32
ZAR 15.310.503	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	575.417	0,11	EUR 648.000	Spain Government Bond 3,45% 30/7/2066	566.250	0,11
ZAR 14.867.089	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026*	763.075	0,15	EUR 1.220.000	Spain Government Bond 3,55% 31/10/2033	1.225.252	0,24
USD 400.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,85% 30/9/2029	325.351	0,07	EUR 352.000	Spain Government Bond 3,9% 30/7/2039	353.038	0,07
USD 200.000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	122.631	0,02	GBP 725.000	Telefonica Emisiones 5,375% 2/2/2026	836.335	0,16
		2.152.551	0,42			27.503.199	5,42
Corée du Sud				Suède			
USD 200.000	LG Chem 2,375% 7/7/2031	148.350	0,03	EUR 175.000	Fastighets Balder 2,873% 2/6/2081	117.722	0,02
USD 200.000	Woori Bank 4,25% 4/10/2024	178.258	0,03	EUR 300.000	Heimstaden Bostad 2,625% 1/2/2027	130.245	0,03
		326.608	0,06	SEK 3.050.000	Sweden Government International Bond 0,125% 9/9/2030	215.451	0,04
Espagne				SEK 20.480.000	Sweden Government International Bond 0,125% 9/9/2030	1.444.483	0,29
EUR 244.215	Autonoria Spain 2021 FT 6,292% 31/1/2039	235.906	0,05	EUR 100.000	Verisure 3,875% 15/7/2026	94.437	0,02
EUR 122.108	Autonoria Spain 2021 FT 7,542% 31/1/2039	117.031	0,02	EUR 160.000	Volvo Treasury 3,625% 25/5/2027	159.163	0,03
EUR 400.000	Banco de Sabadell 1,125% 11/3/2027	369.200	0,07	GBP 210.000	Volvo Treasury 4,75% 15/6/2026	239.309	0,05
EUR 100.000	Banco de Sabadell 2,5% 15/4/2031	89.386	0,02			2.400.810	0,48
EUR 100.000	Banco de Sabadell 2,625% 24/3/2026	96.393	0,02	Suisse			
EUR 200.000	Banco de Sabadell 5,25% 7/2/2029	198.815	0,04	EUR 150.000	Credit Suisse 0,25% 5/1/2026	136.584	0,03
EUR 300.000	Banco Santander 1,125% 23/6/2027	270.551	0,05	EUR 425.000	Credit Suisse 0,25% 1/9/2028	350.948	0,07
EUR 800.000	Banco Santander 3,625% 27/9/2026	790.596	0,16	USD 250.000	Credit Suisse 3,7% 21/2/2025	221.995	0,04
EUR 100.000	Banco Santander 3,75% 16/1/2026	99.143	0,02	EUR 645.000	Credit Suisse 5,5% 20/8/2026	666.584	0,13
EUR 200.000	Banco Santander 4,375% 14/1/2026	168.212	0,03	GBP 100.000	Credit Suisse 7,75% 10/3/2026	120.745	0,02
EUR 100.000	Banco Santander 5,75% 23/8/2033	99.786	0,02	EUR 400.000	UBS 0,65% 14/1/2028	354.016	0,07
EUR 100.000	Bankinter 4,375% 3/5/2030	99.850	0,02	USD 250.000	UBS 1,305% 2/2/2027	205.469	0,04
EUR 300.000	CaixaBank 0,75% 10/7/2026	281.436	0,06	USD 345.000	UBS 2,593% 11/9/2025	306.495	0,06
EUR 200.000	CaixaBank 6,375% 19/9/2023	200.500	0,04	EUR 100.000	UBS 3,25% 2/4/2026	98.116	0,02
EUR 100.000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	87.093	0,02	USD 200.000	UBS 7% 31/1/2024	183.029	0,04
EUR 200.000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	157.502	0,03	USD 200.000	UBS 7% 19/2/2025	179.950	0,03
EUR 300.000	Cellnex Telecom 0,75% 20/11/2031	230.751	0,04	GBP 100.000	UBS 7% 30/9/2027	118.301	0,02
EUR 200.000	Cellnex Telecom 1,75% 23/10/2030*	164.226	0,03	EUR 750.000	UBS 7,75% 1/3/2029	848.040	0,17
EUR 100.000	Cellnex Telecom 1,875% 26/6/2029	85.652	0,02			3.790.272	0,74
				Thaïlande			
				USD 200.000	Krung Thai Bank 4,4% 25/3/2026	167.750	0,03
				Turquie			
				USD 46.930	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 4,2% 15/3/2027	40.164	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Ukraine				GBP 112.000	Canada Square Funding 2021-2 6,214% 17/6/2058	128.731	0,03
EUR 196.000	Ukraine Government International Bond 4,375% 27/1/2032	46.501	0,01	GBP 102.000	Canada Square Funding 2021-2 6,614% 17/6/2058	116.319	0,02
USD 200.000	Ukraine Government International Bond 7,253% 15/3/2035	49.922	0,01	GBP 202.000	Canary Wharf Finance II 7,409% 22/10/2037	186.726	0,04
USD 722.000	Ukraine Government International Bond 7,253% 15/3/2035	180.216	0,04	EUR 221.000	Channel Link Enterprises Finance 2,706% 30/6/2050	202.028	0,04
USD 562.000	Ukraine Government International Bond 7,375% 25/9/2034	137.917	0,03	GBP 100.000	Constellation Automotive Financing 4,875% 15/7/2027*	93.696	0,02
USD 278.000	Ukraine Government International Bond 7,375% 25/9/2034	68.223	0,01	GBP 64.758	Dignity Finance 3,546% 31/12/2034	66.692	0,01
USD 100.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2028	26.637	0,00	GBP 111.000	Dowson 2022-1 7,445% 20/1/2029	128.947	0,02
USD 293.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/9/2029	78.047	0,02	GBP 100.000	Dowson 2022-1 7,895% 20/1/2029	114.779	0,02
USD 255.000	Ukraine Government International Bond 7,75% 1/8/2041	108.116	0,02	EUR 250.000	DS Smith 4,5% 27/7/2030	248.465	0,05
		695.579	0,14	EUR 118.000	EC Finance 3% 15/10/2026	111.030	0,02
Royaume-Uni				GBP 608.000	Finsbury Square 6,247% 16/12/2067	687.412	0,14
EUR 100.000	Agps Bondco 5% 14/1/2029	29.307	0,01	GBP 200.000	Finsbury Square 2021-2 6,697% 16/12/2071	220.121	0,04
EUR 600.000	Agps Bondco 5,5% 13/11/2026	201.750	0,04	GBP 500.000	Funding VI 6,595% 15/7/2026	585.160	0,12
EUR 200.000	Agps Bondco 6% 5/8/2025	77.790	0,02	GBP 137.028	Greene King Finance 3,593% 15/3/2035	133.107	0,03
EUR 200.000	Anglo American Capital 1,625% 18/9/2025	190.880	0,04	GBP 472.000	Harben Finance 6,242% 28/9/2055	526.254	0,10
EUR 240.000	Anglo American Capital 4,75% 21/9/2032*	237.185	0,05	GBP 441.000	Harben Finance 6,592% 28/9/2055	474.919	0,09
EUR 390.000	Anglo American Capital 5% 15/3/2031	392.796	0,08	GBP 100.000	Heathrow Finance 3,875% 1/3/2027	100.846	0,02
GBP 100.000	Atlas Funding 2021-1 7,424% 25/7/2058	116.459	0,02	GBP 200.000	Heathrow Finance 5,75% 3/3/2025*	227.273	0,04
GBP 100.000	Atlas Funding 2023-1 7,095% 20/1/2061	116.487	0,02	GBP 500.000	HSBC 1,75% 24/7/2027	513.652	0,10
USD 227.500	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	183.677	0,04	GBP 100.000	HSBC 2,256% 13/11/2026	106.840	0,02
GBP 500.000	Barclays 1,7% 3/11/2026*	525.519	0,10	EUR 109.000	INEOS Finance 6,625% 15/5/2028	108.451	0,02
GBP 100.000	Barclays 3,75% 22/11/2030	106.650	0,02	EUR 200.000	INEOS Quattro Finance 2 2,5% 15/1/2026	182.395	0,03
EUR 140.000	Barclays 4,918% 8/8/2030	140.261	0,03	EUR 1.320.000	Informa 2,125% 6/10/2025	1.265.042	0,25
EUR 500.000	Barclays 5,262% 29/1/2034	499.893	0,10	GBP 200.000	Iron Mountain UK 3,875% 15/11/2025	220.281	0,04
GBP 200.000	Barclays 7,125% 15/6/2025	215.788	0,04	EUR 100.000	Jaguar Land Rover Automotive 4,5% 15/7/2028*	90.246	0,02
USD 200.000	Barclays 8% 15/6/2024	180.841	0,04	EUR 200.000	Jaguar Land Rover Automotive 6,875% 15/11/2026	202.506	0,04
GBP 100.000	Barley Hill NO 2 6,895% 27/8/2058	112.324	0,02	GBP 158.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,409% 20/7/2058	177.371	0,04
GBP 100.000	BCP V Modular Services Finance II 6,125% 30/11/2028*	95.871	0,02	GBP 103.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,809% 20/7/2058	113.624	0,02
GBP 300.000	Bellis Acquisition 3,25% 16/2/2026	301.360	0,06	USD 230.000	Liquid Telecommunications Financing 5,5% 4/9/2026*	132.654	0,03
GBP 229.000	Bellis Acquisition 4,5% 16/2/2026	234.985	0,05	GBP 100.000	Lloyds Banking 1,875% 15/1/2026	109.970	0,02
EUR 600.000	BP Capital Markets 3,25% 22/3/2026	561.807	0,11	GBP 100.000	Lloyds Banking 2% 12/4/2028	99.628	0,02
EUR 200.000	BP Capital Markets 3,625% 22/3/2029	176.300	0,03	EUR 200.000	Lloyds Banking 4,947% 27/6/2025	187.446	0,04
EUR 580.000	British Telecommunications 1,874% 18/8/2080*	530.584	0,10	GBP 99.603	London Wall Mortgage Capital 5,968% 15/5/2051	115.607	0,02
USD 200.000	British Telecommunications 4,875% 23/11/2081	151.348	0,03	GBP 72.000	Mitchells & Butlers Finance 7,347% 15/6/2036	68.229	0,01
GBP 200.000	British Telecommunications 5,75% 7/12/2028	231.347	0,05	GBP 100.000	Mobico 4,25% 26/11/2025	101.984	0,02
GBP 225.000	British Telecommunications 8,375% 20/12/2083	263.301	0,05	GBP 110.000	Mortimer BTL 2021-1 6,483% 23/6/2053	124.079	0,03
				EUR 200.000	National Grid 3,245% 30/3/2034	179.754	0,04
				GBP 99.000	National Grid Electricity Distribution South West 5,875% 25/3/2027	115.849	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
GBP 400.000	National Grid Electricity Transmission 5,875% 2/2/2024	466.986	0,09	GBP 255.000	Twin Bridges 2022-1 6,658% 1/12/2055	276.743	0,06
GBP 500.000	NatWest 2,057% 9/11/2028	491.054	0,10	GBP 64.772	Unique Pub Finance 5,659% 30/6/2027	74.740	0,02
GBP 150.000	NatWest 2,875% 19/9/2026	162.051	0,03	GBP 27.120	Unique Pub Finance 7,395% 28/3/2024	31.515	0,01
EUR 330.000	NatWest 4,067% 6/9/2028	324.265	0,06	GBP 3.212.849	United Kingdom Gilt 0,5% 22/10/2061	1.110.007	0,22
GBP 100.000	NatWest Markets 6,375% 8/11/2027	117.101	0,02	GBP 962.000	United Kingdom Gilt 0,875% 31/7/2033	809.882	0,16
GBP 283.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6,545% 15/11/2029	326.879	0,06	GBP 100.000	Virgin Media Secured Finance 4,25% 15/1/2030	93.292	0,02
EUR 127.249	Newgate Funding 3,754% 1/12/2050	118.315	0,02	GBP 109.000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	116.339	0,02
EUR 900.000	NGG Finance 1,625% 5/12/2079	858.248	0,17	EUR 300.000	Vmed O2 UK Financing I 3,25% 31/1/2031*	250.182	0,05
GBP 100.000	NIE Finance 2,5% 27/10/2025	108.398	0,02	GBP 100.000	Vmed O2 UK Financing I 4,5% 15/7/2031	90.810	0,02
GBP 214.000	Pinewood Finance 3,25% 30/9/2025	232.349	0,04	EUR 225.000	Vodafone 2,625% 27/8/2080	205.628	0,04
GBP 364.000	Polaris 2022-1 6,697% 23/10/2059	412.211	0,08	EUR 100.000	Vodafone 4,2% 3/10/2078	92.625	0,02
GBP 307.000	Polaris 2022-1 7,197% 23/10/2059	345.690	0,07	GBP 300.000	Vodafone 4,875% 3/10/2078	330.383	0,06
GBP 538.000	Polaris 2022-1 8,597% 23/10/2059	601.508	0,12			28.393.665	5,61
GBP 495.972	Polaris 2023-1 6,447% 23/2/2061	581.301	0,12		États-Unis		
GBP 200.000	Premier Foods Finance 3,5% 15/10/2026*	211.428	0,04	USD 300.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	250.505	0,05
GBP 157.886	RMAC No 1 5,228% 12/6/2044	177.603	0,04	USD 213.867	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 7,485% 15/9/2034	175.017	0,03
USD 125.000	Royalty Pharma 2,2% 2/9/2030	91.967	0,02	USD 80.000	AbbVie 2,6% 21/11/2024	71.101	0,01
GBP 380.000	Sage AR Funding No 1 7,369% 17/11/2030	419.028	0,08	USD 670.000	AbbVie 3,2% 21/11/2029	556.553	0,11
GBP 200.000	Santander UK 6,75% 24/6/2024	226.486	0,05	USD 64.783	AccessLex Institute 5,953% 25/5/2036	58.050	0,01
GBP 123.000	Satus 2021-1 7,096% 17/8/2028	140.933	0,03	USD 293.246	ACE Home Equity Loan Trust Series 2003-OP1 6,149% 25/12/2033	252.471	0,05
GBP 248.000	Satus 2021-1 8,396% 17/8/2028	286.871	0,06	USD 2.439.484	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 6,029% 25/5/2037	399.896	0,08
GBP 100.000	SP Distribution 5,875% 17/7/2026	116.763	0,02	USD 44.002	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-C 2,25% 27/9/2060	39.884	0,01
GBP 200.000	SSE 8,375% 20/11/2028	259.260	0,05	USD 275.491	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-D 2,25% 25/6/2060	247.838	0,05
EUR 124.000	Standard Chartered 4,874% 10/5/2031	123.721	0,02	USD 369.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,5% 15/3/2029	294.929	0,06
GBP 100.000	Stanlington No 2 6,708% 12/6/2045	114.495	0,02	USD 31.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,625% 15/1/2027	27.053	0,01
GBP 100.000	Stanlington No 2 7,158% 12/6/2045	112.723	0,02	USD 144.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,875% 15/2/2030	121.938	0,02
GBP 194.000	Stanlington No 2 8% 12/6/2045	215.890	0,04	USD 14.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 7,5% 15/3/2026	13.117	0,00
EUR 100.000	Synthomer 3,875% 1/7/2025	92.603	0,02	USD 100.000	Alexandria Real Estate Equities 4,5% 30/7/2029	87.415	0,02
EUR 100.000	Thames Water Utilities Finance 0,875% 31/1/2028	83.845	0,02	USD 105.000	Alexandria Real Estate Equities 4,75% 15/4/2035	89.770	0,02
GBP 100.000	Thames Water Utilities Finance 4% 19/6/2025	109.309	0,02	USD 69.000	Allegiant Travel 7,25% 15/8/2027	62.313	0,01
EUR 500.000	Thames Water Utilities Finance 4% 18/4/2027	478.750	0,10	USD 401.792	Alternative Loan Trust 2004-22CB 6,25% 25/10/2034	367.057	0,07
EUR 550.000	Thames Water Utilities Finance 4,375% 18/1/2031	518.323	0,10	USD 15.969	Alternative Loan Trust 2006-OA14 6,16% 25/11/2046	11.436	0,00
GBP 107.000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6,387% 12/7/2063	120.696	0,02	USD 64.802	Alternative Loan Trust 2006-OC10 5,889% 25/11/2036	51.651	0,01
GBP 139.999	Tower Bridge Funding 2021-2 6,718% 20/11/2063	160.029	0,03	USD 730.099	Alternative Loan Trust 2007-OA3 5,709% 25/4/2047	594.615	0,12
GBP 168.999	Tower Bridge Funding 2021-2 7,018% 20/11/2063	188.405	0,04	USD 30.000	AMC Networks 4,75% 1/8/2025	25.913	0,01
GBP 188.000	Tower Bridge Funding 2022-1 6,275% 20/12/2063	211.601	0,04				
GBP 140.000	Twin Bridges 2021-2 6,108% 12/9/2055	156.771	0,03				
GBP 160.000	Twin Bridges 2021-2 6,458% 12/9/2055	175.475	0,04				
GBP 478.000	Twin Bridges 2022-1 6,258% 1/12/2055	529.565	0,11				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 15.000	AMC Networks 5% 1/4/2024	13.690	0,00	USD 68.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	54.049	0,01
USD 91.000	American Express 2,5% 30/7/2024	81.476	0,02	USD 338.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/4/2030	265.901	0,05
USD 175.000	American Express 3% 30/10/2024	156.526	0,03	USD 173.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6,625% 15/1/2028	152.854	0,03
USD 50.000	American Express 4,05% 3/5/2029	43.715	0,01	USD 155.000	Astrazeneca Finance 4,875% 3/3/2028	142.392	0,03
USD 155.000	American Express 4,9% 13/2/2026	141.022	0,03	USD 125.000	Astrazeneca Finance 4,9% 3/3/2030	114.574	0,02
USD 175.000	American Express 4,99% 1/5/2026	158.957	0,03	EUR 800.000	AT&T 2,875% 2/3/2025	744.720	0,15
USD 295.669	American Home Mortgage Investment Trust 2007-1 5,619% 25/5/2047	159.687	0,03	GBP 1.150.000	AT&T 2,9% 4/12/2026*	1.217.055	0,24
USD 225.293	American Homes 4 Rent 2015-SFR1 Trust 0% 17/4/2052	2	0,00	EUR 100.000	AT&T 3,15% 4/9/2036	86.998	0,02
USD 60.000	American Municipal Power 7,834% 15/2/2041	68.001	0,01	EUR 150.000	AT&T 4,3% 18/11/2034	147.021	0,03
EUR 250.000	American Tower 0,4% 15/2/2027	218.899	0,04	GBP 300.000	AT&T 5,5% 15/3/2027*	341.759	0,07
EUR 150.000	American Tower 0,45% 15/1/2027	131.840	0,03	USD 30.000	AvalonBay Communities 3,35% 15/5/2027	25.857	0,01
EUR 100.000	American Tower 0,5% 15/1/2028	85.200	0,02	USD 47.000	AvalonBay Communities 5% 15/2/2033	42.945	0,01
USD 150.000	American Tower 1,5% 31/1/2028	116.100	0,02	EUR 100.000	Avantor Funding 2,625% 1/11/2025	95.263	0,02
EUR 900.000	American Tower 1,95% 22/5/2026*	847.442	0,17	USD 200.000	Azul Investments 5,875% 26/10/2024	169.594	0,03
USD 50.000	American Tower 2,1% 15/6/2030	36.793	0,01	USD 200.000	Azul Secured Finance 11,93% 28/8/2028	183.577	0,04
USD 250.000	American Tower 2,3% 15/9/2031	180.431	0,04	USD 180.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3,716% 14/4/2033	141.956	0,03
USD 180.000	American Tower 2,7% 15/4/2031	135.728	0,03	USD 100.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,358% 15/11/2033	86.898	0,02
USD 100.000	American Tower 2,95% 15/1/2025	88.603	0,02	USD 157.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,758% 15/11/2033	133.117	0,03
EUR 270.000	American Tower 4,125% 16/5/2027*	268.626	0,05	USD 175.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,858% 15/11/2032	135.422	0,03
USD 131.000	American Tower 5,25% 15/7/2028	118.854	0,02	USD 100.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 6,708% 15/9/2034	91.536	0,02
USD 200.000	American Tower 5,65% 15/3/2033	183.637	0,04	USD 122.591	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 7,058% 15/9/2034	111.946	0,02
USD 125.000	Amgen 1,65% 15/8/2028	98.228	0,02	USD 68.000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2015-UBS7 4,482% 15/9/2048	56.295	0,01
USD 50.000	Amgen 2% 15/1/2032	36.175	0,01	EUR 100.000	Banff Merger Sub 8,375% 1/9/2026	97.730	0,02
USD 225.000	Amgen 2,3% 25/2/2031	171.297	0,03	EUR 300.000	Bank of America 0,58% 8/8/2029	253.128	0,05
USD 105.000	Amgen 2,45% 21/2/2030	82.353	0,02	EUR 100.000	Bank of America 0,583% 24/8/2028	86.904	0,02
USD 75.000	Amgen 3% 22/2/2029	62.449	0,01	USD 35.000	Bank of America 1,658% 11/3/2027	29.146	0,01
USD 415.000	Amgen 4,05% 18/8/2029	361.069	0,07	USD 50.000	Bank of America 1,922% 24/10/2031	36.122	0,01
USD 350.000	Amgen 5,15% 2/3/2028	322.036	0,06	EUR 450.000	Bank of America 1,949% 27/10/2026	428.658	0,08
GBP 400.000	Amgen 5,5% 7/12/2026*	465.011	0,09	USD 165.000	Bank of America 2,299% 21/7/2032	120.041	0,02
USD 120.000	Amkor Technology 6,625% 15/9/2027	110.712	0,02	USD 1.155.000	Bank of America 2,456% 22/10/2025	1.023.306	0,20
USD 50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 3,5% 1/6/2030	42.398	0,01	USD 350.000	Bank of America 2,496% 13/2/2031	268.343	0,05
EUR 300.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028*	249.181	0,05	USD 180.000	Bank of America 2,572% 20/10/2032	132.966	0,03
EUR 100.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029	75.193	0,02	USD 50.000	Bank of America 2,592% 29/4/2031	38.366	0,01
USD 584.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3,25% 1/9/2028	457.655	0,09				
USD 13.000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	12.221	0,00				
USD 115.000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 7,583% 15/4/2035	101.938	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 165.000	Bank of America 3,705% 24/4/2028	142.289	0,03	USD 100.000	Becton Dickinson 4,693% 13/2/2028	90.447	0,02
USD 80.000	Bank of America 3,824% 20/1/2028	69.464	0,01	USD 101.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	92.687	0,02
USD 70.000	Bank of America 3,97% 5/3/2029	60.240	0,01	EUR 200.000	Booking 4% 15/11/2026	202.016	0,04
USD 70.000	Bank of America 3,974% 7/2/2030	59.481	0,01	EUR 100.000	Boxer Parent 6,5% 2/10/2025	99.360	0,02
USD 278.000	Bank of America 4,376% 27/4/2028	245.830	0,05	USD 80.000	BP Capital Markets America 3,588% 14/4/2027	70.300	0,01
USD 510.000	Bank of America 5,202% 25/4/2029	462.979	0,09	USD 110.000	BP Capital Markets America 3,937% 21/9/2028	96.733	0,02
USD 26.610.000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 0,735% 15/2/2050	445.789	0,09	USD 267.000	Broadcom 2,45% 15/2/2031	198.503	0,04
USD 125.000	Bank of New York Mellon 4,947% 26/4/2027	113.365	0,02	USD 150.000	Broadcom 3,419% 15/4/2033	114.718	0,02
USD 80.000	Bay Area Toll Authority 6,918% 1/4/2040	84.113	0,02	USD 100.000	Broadcom 4% 15/4/2029	84.953	0,02
USD 257.800	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 5,749% 25/11/2035	215.843	0,04	USD 285.000	Broadcom 4,15% 15/11/2030	240.225	0,05
USD 252.747	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 5,879% 25/1/2036	213.847	0,04	USD 100.000	Broadcom 4,3% 15/11/2032	83.376	0,02
USD 431.430	Bayview Commercial Asset Trust 2006-2 5,849% 25/7/2036	360.957	0,07	USD 750.000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3,875% 15/1/2027	656.341	0,13
USD 196.768	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5,729% 25/10/2036	168.009	0,03	USD 128.730	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,454% 10/3/2033	111.404	0,02
USD 74.599	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 5,774% 25/12/2036	63.528	0,01	USD 125.065	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,633% 10/3/2033	104.040	0,02
USD 196.549	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 5,834% 25/3/2037	163.027	0,03	USD 641.359	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,717% 10/3/2033	520.521	0,10
USD 294.171	Bayview Commercial Asset Trust 2007-2 5,699% 25/7/2037	240.631	0,05	USD 27.000	BXP Trust 2017-CC 3,67% 13/8/2037	18.329	0,00
USD 107.273	Bayview Commercial Asset Trust 2008-2 7,929% 25/4/2038	96.499	0,02	USD 104.000	BXP Trust 2017-CC 3,67% 13/8/2037	66.399	0,01
USD 118.964	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 6,435% 28/5/2039	88.432	0,02	USD 45.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	31.771	0,01
USD 88.309	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 6,435% 28/2/2040	71.321	0,01	USD 45.000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2033	43.723	0,01
USD 40.000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 4,409% 5/8/2038	24.244	0,00	USD 80.000	California State Public Works Board 8,361% 1/10/2034	89.833	0,02
USD 100.000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6,479% 15/3/2037	77.993	0,02	USD 235.000	Calpine 5,125% 15/3/2028	198.078	0,04
USD 236.091	BCAP 2011-RR5-I Trust 4,137% 28/5/2036	206.905	0,04	USD 110.000	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 7,575% 15/12/2037	100.130	0,02
USD 213.360	BCAP Trust 2007-AA4 4,244% 25/6/2047	89.767	0,02	USD 70.000	Canaveral Port Authority 5% 1/6/2045	65.578	0,01
USD 180.000	BDS 2022-FL12 7,45% 19/8/2038	165.667	0,03	USD 30.000	Canaveral Port Authority 5% 1/6/2048	28.040	0,01
USD 66.231	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE7 5,769% 25/9/2036	60.019	0,01	USD 545.000	Capital One Financial 6,377% 8/6/2034	497.389	0,10
USD 108.363	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-FS1 5,769% 25/5/2035	98.497	0,02	USD 389.661	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC3 5,579% 25/8/2036	337.473	0,07
USD 151.000	Beazer Homes USA 7,25% 15/10/2029	134.378	0,03	USD 274.718	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 5,689% 25/2/2037	235.172	0,05
USD 200.000	Becton Dickinson 1,957% 11/2/2031	148.192	0,03	USD 82.000	Carrols Restaurant 5,875% 1/7/2029	65.112	0,01
USD 100.000	Becton Dickinson 3,734% 15/12/2024	89.936	0,02	EUR 100.000	Catalent Pharma Solutions 2,375% 1/3/2028	83.756	0,02
				USD 163.000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	138.584	0,03
				USD 72.000	CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3,911% 13/11/2050	53.688	0,01
				USD 151.000	CenterPoint Energy Houston Electric 5,3% 1/4/2053	138.609	0,03
				USD 26.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	24.288	0,00
				USD 632.000	Century Communities 6,75% 1/6/2027	580.971	0,12
				USD 248.756	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 1,859% 10/1/2048	7.830	0,00
				USD 539.168	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0,851% 10/5/2058	8.248	0,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 82.391	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 4,998% 10/5/2058	68.554	0,01	USD 492.000	Commercial Metals 4,125% 15/1/2030	401.819	0,08
USD 164.000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2017-C8 4,199% 15/6/2050	128.808	0,03	USD 188.000	Commercial Metals 4,375% 15/3/2032	148.514	0,03
USD 124.000	Charles Schwab 5,875% 24/8/2026	114.946	0,02	USD 20.000	Commonwealth Financing Authority 4,144% 1/6/2038	16.498	0,00
USD 33.558	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 6% 25/12/2037	13.591	0,00	USD 15.000	Commonwealth of Massachusetts 2,9% 1/9/2049	9.557	0,00
EUR 100.000	Chemours 4% 15/5/2026	94.334	0,02	USD 220.000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/9/2049	215.023	0,04
USD 25.000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2051	23.091	0,00	USD 10.000	Commonwealth of Massachusetts 5,456% 1/12/2039	9.552	0,00
EUR 150.000	Citigroup 1,5% 24/7/2026	142.700	0,03	USD 65.000	Concentrix 6,6% 2/8/2028	58.663	0,01
USD 215.000	Citigroup 2,561% 1/5/2032	159.682	0,03	USD 125.000	Concentrix 6,65% 2/8/2026	115.292	0,02
USD 400.000	Citigroup 2,572% 3/6/2031	304.714	0,06	USD 65.000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	60.112	0,01
USD 215.000	Citigroup 2,666% 29/1/2031	166.143	0,03	USD 37.000	Conservation Fund A Nonprofit 3,474% 15/12/2029	29.275	0,01
USD 516.000	Citigroup 3,07% 24/2/2028	436.354	0,09	USD 216.000	Consumers Energy 4,9% 15/2/2029	197.386	0,04
USD 25.000	Citigroup 3,98% 20/3/2030	21.181	0,00	USD 40.000	Contra Costa Community College District 6,504% 1/8/2034	40.656	0,01
USD 150.000	Citigroup 4,412% 31/3/2031	128.355	0,03	EUR 106.000	Coty 3,875% 15/4/2026	103.109	0,02
USD 77.879	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 5,257% 11/3/2047	69.246	0,01	USD 25.000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030	22.978	0,00
USD 1.273.487	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 5,699% 25/5/2037	759.980	0,15	USD 40.000	County of Broward Airport System Revenue 2,914% 1/10/2032	31.002	0,01
USD 375.511	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL3 5,599% 25/7/2045	233.501	0,05	USD 165.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2,529% 1/10/2030	129.776	0,03
USD 379.903	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AMC1 5,749% 25/12/2036	192.852	0,04	USD 70.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2040	65.247	0,01
USD 104.000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-C 4,25% 25/2/2054	86.701	0,02	USD 225.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	178.552	0,04
USD 37.536	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A6 6% 25/6/2037	30.052	0,01	USD 106	Credit Suisse First Boston Mortgage 4,877% 15/4/2037	94	0,00
USD 40.000	City of Atlanta Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2040	37.563	0,01	USD 892.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	800.560	0,16
USD 50.000	City of Riverside Electric Revenue 7,605% 1/10/2040	56.168	0,01	USD 275.000	Crown Castle 2,5% 15/7/2031	204.623	0,04
EUR 200.000	Clarios Global / Clarios US Finance 4,375% 15/5/2026	193.682	0,04	USD 263.000	Crown Castle 2,9% 15/3/2027	222.380	0,04
USD 6.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	4.965	0,00	USD 135.000	Crown Castle 3,1% 15/11/2029	108.260	0,02
USD 346.000	Cleveland-Cliffs 6,75% 15/4/2030	304.641	0,06	USD 75.000	Crown Castle 4,3% 15/2/2029	64.924	0,01
USD 677.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	558.140	0,11	USD 179.000	Crown Castle 5% 11/1/2028	161.908	0,03
USD 818.000	Comcast 4,65% 15/2/2033	737.218	0,15	USD 238.000	CrownRock / CrownRock Finance 5,625% 15/10/2025	215.724	0,04
USD 51.000	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust 3,961% 10/3/2047	46.574	0,01	USD 131.000	CSC 5,25% 1/6/2024	114.695	0,02
USD 135.000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 4,514% 10/9/2047	116.999	0,02	USD 200.000	CSC 5,5% 15/4/2027	159.089	0,03
USD 800.000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 4,183% 10/5/2048	686.521	0,14	USD 963.364	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-10 6,25% 25/11/2035	208.703	0,04
USD 188.184	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 0,942% 10/8/2048	2.124	0,00	USD 5.600.893	CSMC 2014-USA OA 0,186% 15/9/2037	7.100	0,00
USD 121.000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 4,667% 10/8/2048	100.575	0,02	USD 1.747.557	CSMC Mortgage-Backed Trust 2007-5 7% 25/8/2037	998.346	0,20
USD 100.000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3,829% 10/2/2048	84.002	0,02	USD 704.614	CSMC Series 2014-9R 5,652% 27/8/2036	616.184	0,12
USD 63.220	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust 3,774% 10/10/2048	55.496	0,01	USD 205.000	CVS Health 1,3% 21/8/2027	162.546	0,03
USD 5.344.578	COMM 2016-667M Mortgage Trust 0,145% 10/10/2036	10.356	0,00	USD 362.000	CVS Health 1,75% 21/8/2030	264.991	0,05
USD 139.725	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 1,75% 10/5/2051	8.193	0,00	USD 95.000	CVS Health 1,875% 28/2/2031	68.667	0,01
				USD 55.000	CVS Health 3,625% 1/4/2027	47.978	0,01
				USD 95.986	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-22 5,659% 25/5/2047	70.617	0,01
				USD 34.501	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I 5,565% 15/1/2037	29.140	0,01

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 30.000	Dallas Fort Worth International Airport 3,144% 1/11/2045	20.786	0,00	USD 1.811.565	Fannie Mae Pool 2,5% 1/5/2050	1.398.803	0,28
USD 48.000	Dana 4,25% 1/9/2030	36.371	0,01	USD 2.701.632	Fannie Mae Pool 2,5% 1/9/2050	2.085.842	0,41
USD 210.732	DBJPM 2017-C6 Mortgage Trust 1% 10/6/2050	5.899	0,00	USD 2.432.880	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2051	1.862.079	0,37
USD 208.735	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	149.420	0,03	USD 2.630	Fannie Mae Pool 3,5% 1/1/2048	2.218	0,00
USD 287.000	Dell International / EMC 6,02% 15/6/2026	267.240	0,05	USD 17.011	Fannie Mae Pool 3,5% 1/12/2050	14.281	0,00
USD 45.000	District of Columbia 5% 15/7/2034	42.530	0,01	USD 812.885	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	696.642	0,14
USD 45.000	District of Columbia 5% 15/7/2035	42.264	0,01	USD 577.733	Fannie Mae REMICS 3,5% 25/2/2051	95.597	0,02
USD 150.000	Dollar General 3,5% 3/4/2030	123.040	0,02	USD 467.388	Fannie Mae REMICS 4% 25/5/2050	88.905	0,02
USD 80.000	Dollar General 3,875% 15/4/2027	70.394	0,01	USD 976.987	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	181.262	0,04
USD 100.000	Dresdner Funding Trust I 8,151% 30/6/2031	98.738	0,02	USD 737.374	Fannie Mae REMICS 4% 25/6/2051	135.383	0,03
USD 50.000	DuBois Hospital Authority 5% 15/7/2043	46.523	0,01	USD 458.243	Fannie Mae REMICS 4% 25/8/2051	79.357	0,02
USD 1.000.000	Duke Energy Florida 2,4% 15/12/2031	753.030	0,15	EUR 1.100.000	Fidelity National Information Services 0,625% 3/12/2025	1.023.715	0,20
USD 60.000	Eaton 4,35% 18/5/2028	54.275	0,01	USD 96.000	Fidelity National Information Services 1,15% 1/3/2026	79.620	0,02
USD 370.000	Ecolab 2,125% 1/2/2032	277.735	0,05	EUR 182.000	Fidelity National Information Services 1,5% 21/5/2027	167.069	0,03
USD 150.000	Ecolab 5,25% 15/1/2028	140.075	0,03	USD 235.000	Fifth Third Bancorp 6,339% 27/7/2029	219.084	0,04
USD 50.000	Edison International 6,95% 15/11/2029	48.529	0,01	USD 2.222.304	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FFH1 6,029% 25/1/2036	1.767.118	0,35
USD 95.000	Elanco Animal Health 6,65% 28/8/2028	86.577	0,02	GBP 100.000	Fiserv 2,25% 1/7/2025	109.312	0,02
USD 305.000	Elevance Health 2,55% 15/3/2031	235.369	0,05	USD 459.000	Five Point Operating / Five Point Capital 7,875% 15/11/2025*	396.896	0,08
USD 150.000	Elevance Health 2,875% 15/9/2029	122.018	0,02	USD 330.843	Flagstar Mortgage Trust 2018-6RR 4,921% 25/10/2048	260.903	0,05
USD 80.000	Elevance Health 3,65% 1/12/2027	69.512	0,01	USD 169.000	Florida Power & Light 4,4% 15/5/2028	152.245	0,03
USD 50.000	Elevance Health 4,1% 15/5/2032	42.555	0,01	USD 410.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032	295.561	0,06
USD 150.000	Elevance Health 4,9% 8/2/2026	136.361	0,03	USD 140.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	123.161	0,03
USD 250.000	Elmwood CLO 15 6,686% 22/4/2035	228.885	0,04	GBP 105.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	117.331	0,02
USD 290.000	Elmwood CLO 15 9,016% 22/4/2035	261.621	0,05	EUR 100.000	Ford Motor Credit 4,867% 3/8/2027	98.699	0,02
EUR 100.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	100.022	0,02	USD 444.000	Ford Motor Credit 5,584% 18/3/2024	407.270	0,08
USD 79.000	Emerald Debt Merger Sub 6,625% 15/12/2030	71.654	0,01	EUR 100.000	Ford Motor Credit 6,125% 15/5/2028	102.687	0,02
EUR 200.000	Encore Capital 4,875% 15/10/2025*	191.279	0,04	GBP 252.000	Ford Motor Credit 6,86% 5/6/2026	287.401	0,06
EUR 600.000	Equinix 0,25% 15/3/2027	530.043	0,11	USD 80.000	Forestar 3,85% 15/5/2026	68.426	0,01
USD 1.220.000	Equinix 1% 15/9/2025	1.025.582	0,20	USD 666.000	Forestar 5% 1/3/2028	568.431	0,11
USD 130.000	Equinix 1,25% 15/7/2025	110.427	0,02	USD 2.105.062	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0,941% 25/5/2029	66.798	0,01
USD 45.000	Equinix 2,9% 18/11/2026	38.315	0,01	USD 3.259.000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,024% 25/6/2029	132.492	0,03
USD 140.000	Equinix 3,2% 18/11/2029	112.929	0,02	USD 1.875.777	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,119% 25/10/2030	95.096	0,02
USD 460.000	EquipmentShare.com 9% 15/5/2028	421.719	0,08	USD 3.040.000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,467% 25/12/2029	162.352	0,03
USD 1.000.000	ERP Operating 4,15% 1/12/2028	876.225	0,17	USD 214.510	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2050	32.950	0,01
USD 121.000	Eversource Energy 2,9% 1/10/2024	108.209	0,02	USD 386.392	Freddie Mac REMICS 3% 25/3/2051	58.835	0,01
USD 155.000	Eversource Energy 4,75% 15/5/2026	140.511	0,03				
USD 925.473	Fannie Mae Interest Strip 3% 25/10/2049	135.346	0,03				
USD 1.341.679	Fannie Mae Interest Strip 3% 25/3/2050	212.076	0,04				
USD 581.366	Fannie Mae Interest Strip 3,5% 25/8/2049	95.665	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net			Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 242.246	Freddie Mac REMICS 3% 25/6/2051	35.716	0,01	USD 146.070	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	118.267	0,02
USD 153.811	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	22.953	0,00	USD 97.102	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	79.307	0,02
USD 588.017	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	80.237	0,02	USD 73.384	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	59.937	0,01
USD 182.265	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	26.262	0,01	USD 3.937.677	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2050	3.387.335	0,67
USD 219.128	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	33.933	0,01	USD 3.776.265	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2050	3.176.144	0,63
USD 751.121	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	92.289	0,02	USD 90.622	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	77.749	0,02
USD 727.072	Freddie Mac REMICS 3% 25/2/2052	113.320	0,02	USD 87.324	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	74.829	0,01
USD 315.063	Freddie Mac REMICS 3,5% 25/3/2051	50.364	0,01	USD 49.125	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	42.036	0,01
USD 827.104	Freddie Mac REMICS 3,5% 25/6/2051	139.341	0,03	USD 209.675	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	175.135	0,03
USD 388.819	Freddie Mac REMICS 3,5% 25/10/2051	65.254	0,01	EUR 271.000	Global Payments 4,875% 17/3/2031	270.852	0,05
USD 194.496	Freddie Mac REMICS 4% 25/12/2050	34.940	0,01	EUR 600.000	Goldman Sachs 0,875% 9/5/2029	494.841	0,10
USD 3.308.448	Freddie Mac Strips 3% 15/10/2052	505.192	0,10	USD 144.000	Goldman Sachs 1,431% 9/3/2027	118.988	0,02
USD 142.000	Freedom Mortgage 8,125% 15/11/2024	130.399	0,03	USD 110.000	Goldman Sachs 1,542% 10/9/2027	89.480	0,02
USD 88.000	Freedom Mortgage 8,25% 15/4/2025	79.913	0,02	USD 170.000	Goldman Sachs 1,948% 21/10/2027	139.352	0,03
USD 57.565	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust 3,715% 25/10/2027	48.413	0,01	USD 100.000	Goldman Sachs 1,992% 27/1/2032	71.840	0,01
USD 586.000	FREMF 2018-KW05 Trust 3,786% 25/4/2028	454.542	0,09	USD 50.000	Goldman Sachs 2,383% 21/7/2032	36.435	0,01
USD 8.886.092	FREMF 2019-KW08 Mortgage Trust 0,1% 25/1/2029	30.303	0,01	USD 75.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	55.991	0,01
USD 292.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	245.255	0,05	USD 75.000	Goldman Sachs 3,5% 23/1/2025	66.976	0,01
USD 245.000	Frontier Communications 8,625% 15/3/2031	216.818	0,04	USD 344.000	Goldman Sachs 3,615% 15/3/2028	296.488	0,06
USD 368.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	329.282	0,07	USD 508.002	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2,1% 20/5/2048	357.875	0,07
USD 1.000.000	Frontier Florida 6,86% 1/2/2028	859.702	0,17	USD 403.000	GoTo 5,5% 1/9/2027	217.625	0,04
USD 140.000	Frontier North 6,73% 15/2/2028	117.705	0,02	USD 114.976	Government National Mortgage Association 0,519% 16/9/2053	1.500	0,00
USD 433.000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7,894% 17/8/2037	401.095	0,08	USD 22.187	Government National Mortgage Association 0,618% 16/10/2056	535	0,00
USD 93.758	GAM Resecuritization Trust 2018-B 6,5% 27/8/2051	81.003	0,02	USD 27.134	Government National Mortgage Association 0,679% 16/8/2057	715	0,00
USD 15.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	14.745	0,00	USD 136.140	Government National Mortgage Association 0,77% 16/12/2057	4.602	0,00
USD 600.000	GATX 3,1% 1/6/2051	344.198	0,07	USD 17.811	Government National Mortgage Association 0,923% 16/2/2050	382	0,00
USD 121.000	Gen Digital 6,75% 30/9/2027	111.585	0,02	USD 204.844	Government National Mortgage Association 2,5% 20/9/2050	24.706	0,00
USD 123.000	Gen Digital 7,125% 30/9/2030	114.374	0,02	USD 426.828	Government National Mortgage Association 2,5% 20/10/2050	46.391	0,01
USD 50.000	General Mills 2,875% 15/4/2030	40.305	0,01	USD 424.706	Government National Mortgage Association 2,5% 20/10/2050	51.432	0,01
USD 1.408.000	General Motors 5,4% 15/10/2029	1.253.031	0,25	USD 136.371	Government National Mortgage Association 2,5% 20/11/2050	16.479	0,00
GBP 100.000	General Motors Financial 5,15% 15/8/2026	113.634	0,02	USD 518.391	Government National Mortgage Association 2,5% 20/12/2050	62.947	0,01
USD 150.000	Gilead Sciences 1,65% 1/10/2030	111.033	0,02	USD 1.649.191	Government National Mortgage Association 3% 20/5/2051	223.171	0,04
USD 75.000	Gilead Sciences 3,65% 1/3/2026	66.430	0,01	USD 895.997	Government National Mortgage Association 3% 20/8/2051	124.605	0,02
USD 87.775	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/9/2050	68.164	0,01	USD 221.282	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	24.296	0,00
USD 74.557	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/9/2050	58.382	0,01	USD 115.020	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	12.666	0,00
USD 131.761	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/9/2050	102.180	0,02	USD 214.681	Government National Mortgage Association 3,5% 20/1/2051	33.230	0,01
USD 2.577.007	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2050	2.104.708	0,42	USD 331.553	Government National Mortgage Association 3,5% 20/10/2051	48.090	0,01
USD 3.517.039	Ginnie Mae II Pool 3% 20/7/2050	2.789.896	0,55	USD 135.017	Government National Mortgage Association 3,5% 20/11/2051	17.069	0,00
USD 68.965	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	56.332	0,01				

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 208.178	Government National Mortgage Association 4% 20/5/2051	37.103	0,01	USD 125.000	Intercontinental Exchange 3,1% 15/9/2027	106.588	0,02
USD 102.692	Government National Mortgage Association 4% 20/9/2051	15.011	0,00	USD 200.000	IQVIA 5% 15/10/2026	178.397	0,04
USD 295.828	Government National Mortgage Association 4% 20/12/2051	42.953	0,01	USD 209.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-NINE 2,949% 6/9/2038	162.547	0,03
USD 84.500	Grand Canyon University 3,25% 1/10/2023	76.911	0,01	USD 70.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-AON 4,128% 5/7/2031	59.176	0,01
USD 242.000	Grand Canyon University 5,125% 1/10/2028	201.595	0,04	USD 358.562	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-PHH 6,567% 15/6/2035	308.784	0,06
USD 25.000	Great Lakes Water Authority Water Supply System Revenue 5,25% 1/7/2033	24.247	0,01	USD 75.000	JobsOhio Beverage System 3,985% 1/1/2029	67.361	0,01
USD 803.742	Greenpoint Manufactured Housing 9,23% 15/12/2029	651.655	0,13	USD 168.259	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4,881% 15/1/2049	130.405	0,03
USD 117.735	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5,366% 3/5/2032	105.128	0,02	USD 650.000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH1 4,589% 25/11/2036	586.605	0,12
USD 100.000	GS Mortgage Trust 2015-590M 3,932% 10/10/2035	77.031	0,02	USD 132.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4,359% 17/3/2049	99.704	0,02
USD 95.000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 4,554% 10/7/2048	78.471	0,02	USD 24.000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2018-C8 4,421% 15/6/2051	19.726	0,00
USD 1.155.505	GSA Home Equity Trust 2006-4 3,644% 25/3/2036	760.513	0,15	USD 1.180.000	JPMorgan Chase 0,768% 9/8/2025	1.033.656	0,20
USD 215.185	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP2 5,779% 25/3/2035	172.984	0,03	EUR 400.000	JPMorgan Chase 1,638% 18/5/2028	366.970	0,07
USD 111.782	GSR Mortgage Loan Trust 2007-OA2 2,929% 25/6/2047	66.058	0,01	USD 100.000	JPMorgan Chase 1,764% 19/11/2031	72.163	0,01
USD 275.000	GXO Logistics 2,65% 15/7/2031	198.651	0,04	USD 140.000	JPMorgan Chase 2,182% 1/6/2028	114.567	0,02
USD 152.000	HCA 3,125% 15/3/2027	128.589	0,03	USD 75.000	JPMorgan Chase 2,739% 15/10/2030	59.229	0,01
USD 100.000	HCA 3,5% 1/9/2030	80.553	0,02	USD 509.000	JPMorgan Chase 4,323% 26/4/2028	450.650	0,09
USD 50.000	HCA 3,625% 15/3/2032	39.635	0,01	USD 417.000	JPMorgan Chase 4,851% 25/7/2028	376.780	0,07
USD 326.000	HCA 5,375% 1/2/2025	298.504	0,06	USD 330.000	JPMorgan Chase 6,577% 2/2/2037	261.919	0,05
USD 140.000	HCA 5,875% 1/2/2029	129.714	0,03	USD 300.000	Keurig Dr Pepper 3,95% 15/4/2029	260.105	0,05
USD 35.000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2029	33.295	0,01	USD 285.000	Keurig Dr Pepper 4,597% 25/5/2028	256.437	0,05
USD 1.270.000	Healthpeak 1,35% 1/2/2027	1.026.059	0,20	USD 643.335	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A 6,869% 28/7/2042	554.260	0,11
USD 300.000	Hilton Domestic Operating 4,875% 15/1/2030	258.120	0,05	USD 452.320	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A 6,844% 27/12/2038	397.957	0,08
USD 329.000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4,875% 1/4/2027	292.869	0,06	USD 1.030.000	Kilroy Realty 2,5% 15/11/2032	668.030	0,13
USD 465.000	Home Depot 1,375% 15/3/2031	335.867	0,07	USD 125.000	Kraft Heinz Foods 3,75% 1/4/2030	105.602	0,02
USD 900.000	Home Equity Asset Trust 2006-3 6,029% 25/7/2036	748.292	0,15	USD 90.000	Kraft Heinz Foods 4,25% 1/3/2031	77.740	0,02
USD 2.030.191	Home Equity Mortgage Trust 2006-2 5,867% 25/7/2036	220.807	0,04	EUR 200.000	Kronos International 3,75% 15/9/2025	182.282	0,04
USD 240.000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3,982% 5/3/2037	200.583	0,04	USD 12.963.725	Ladder Capital Commercial Mortgage 2013-GCP Mortgage Trust 1,322% 15/2/2036	483.366	0,10
USD 162.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	134.844	0,03	USD 14.000	Lamar Media 3,75% 15/2/2028	11.753	0,00
USD 11.000	iHeartCommunications 4,75% 15/1/2028	7.828	0,00	USD 143.668	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 5,879% 25/9/2036	115.026	0,02
USD 18.000	iHeartCommunications 5,25% 15/8/2027	13.181	0,00	USD 680.000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-3 7,429% 25/10/2037	532.167	0,11
USD 19.487	iHeartCommunications 6,375% 1/5/2026	15.675	0,00	USD 67.265	Lehman XS Trust Series 2007-16N 7,329% 25/9/2047	77.779	0,02
USD 49.915	Impac Secured Assets Trust 2006-3 5,769% 25/11/2036	40.821	0,01				
USD 269.829	IMT Trust 2017-APTS 3,613% 15/6/2034	238.185	0,05				
USD 128.180	IMT Trust 2017-APTS 3,613% 15/6/2034	114.123	0,02				
USD 300.000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 4,158% 10/7/2035	256.010	0,05				
USD 486.099	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR35 5,789% 25/1/2037	395.307	0,08				
USD 185.000	Intercontinental Exchange 1,85% 15/9/2032	129.903	0,03				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 50.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	42.194	0,01	USD 667.000	Morgan Stanley 4,21% 20/4/2028	587.721	0,12
EUR 200.000	Liberty Mutual 3,625% 23/5/2059	190.908	0,04	USD 25.000	Morgan Stanley 4,431% 23/1/2030	21.845	0,00
USD 463.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	258.292	0,05	EUR 200.000	Morgan Stanley 4,656% 2/3/2029	202.192	0,04
USD 874.977	Loanpal Solar Loan 2,47% 20/12/2047	610.907	0,12	USD 286.000	Morgan Stanley 5,05% 28/1/2027	260.628	0,05
USD 217.905	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 5,749% 25/8/2036	80.285	0,02	USD 57.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	52.172	0,01
USD 105.000	Los Angeles Unified School District 6,758% 1/7/2034	107.876	0,02	USD 108.324	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2007-SEA1 9,229% 25/2/2047	91.238	0,02
USD 100.000	Louisiana Public Facilities Authority 3% 15/5/2047	62.242	0,01	USD 281.000	Morgan Stanley Bank 4,754% 21/4/2026	255.344	0,05
USD 45.000	Louisiana Public Facilities Authority 5% 1/7/2048	42.435	0,01	USD 250.000	Morgan Stanley Bank 5,479% 16/7/2025	230.502	0,05
USD 135.000	Lowe's 1,7% 15/10/2030	98.843	0,02	USD 175.457	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1,328% 15/12/2047	2.399	0,00
USD 250.000	Lowe's 2,625% 1/4/2031	193.483	0,04	USD 505.116	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1,328% 15/12/2047	6.227	0,00
USD 150.000	Lowe's 3,1% 3/5/2027	128.621	0,03	USD 160.798	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 0,41% 15/3/2048	622	0,00
USD 50.000	Lowe's 3,75% 1/4/2032	41.287	0,01	USD 160.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4,468% 15/5/2048	134.951	0,03
USD 75.000	Lowe's 4,5% 15/4/2030	66.640	0,01	USD 10.078	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 4,668% 15/10/2048	8.261	0,00
USD 60.000	Lowe's 4,8% 1/4/2026	54.633	0,01	USD 245.091	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 1,452% 15/10/2048	5.549	0,00
USD 9.131	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 3,279% 20/4/2048	8.113	0,00	USD 17.408	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2,73% 15/12/2050	9.767	0,00
USD 192.000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4,108% 15/8/2034	150.201	0,03	USD 120.942	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 2,307% 15/6/2050	7.609	0,00
USD 169.000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4,167% 15/8/2034	119.611	0,02	USD 133.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	83.078	0,02
USD 40.000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5% 15/8/2027	37.546	0,01	USD 100.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	79.563	0,02
USD 35.000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2043	32.903	0,01	USD 50.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 6,58% 15/7/2035	45.798	0,01
USD 15.000	Massachusetts Housing Finance Agency 4,5% 1/12/2039	13.265	0,00	USD 331.162	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 2006-3 5,749% 25/4/2036	219.590	0,04
USD 150.000	Massachusetts School Building Authority 2,866% 15/10/2031	118.849	0,02	USD 56.951	Morgan Stanley Resecuritization Trust 2013-R7 5,732% 26/12/2046	48.233	0,01
USD 120.000	Massachusetts School Building Authority 2,966% 15/10/2032	94.148	0,02	USD 69.037	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1 4,01% 22/6/2043	57.938	0,01
USD 497.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	450.589	0,09	USD 302.368	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 4,2% 22/2/2044	251.447	0,05
USD 1.357.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	1.089.993	0,21	USD 472.028	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 5,97% 22/2/2044	364.017	0,07
USD 477.543	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-H1 8,929% 25/10/2037	397.109	0,08	USD 217.981	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 4,37% 21/12/2043	184.037	0,04
USD 65.000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2046	60.299	0,01	USD 86.274	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4,38% 21/1/2053	73.923	0,01
USD 15.000	Metropolitan Life Global Funding I 1,875% 11/1/2027	12.348	0,00	USD 267.665	Mosaic Solar Loans 2017-2 2% 22/6/2043	239.504	0,05
USD 55.000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2041	52.877	0,01	USD 412.156	MSCG Trust 2018-SELF 7,508% 15/10/2037	371.892	0,07
EUR 100.000	Moody's 0,95% 25/2/2030	84.251	0,02	USD 45.694	MSCG Trust 2018-SELF 8,408% 15/10/2037	41.336	0,01
EUR 100.000	Morgan Stanley 0,495% 26/10/2029	82.778	0,02	USD 182.430	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 6,5% 25/3/2034	143.332	0,03
EUR 350.000	Morgan Stanley 1,102% 29/4/2033*	269.304	0,05	USD 41.902	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 7,5% 25/3/2034	34.035	0,01
USD 37.000	Morgan Stanley 1,512% 20/7/2027	30.261	0,01	EUR 160.000	Nasdaq 4,5% 15/2/2032	162.797	0,03
USD 100.000	Morgan Stanley 1,794% 13/2/2032	70.959	0,01				
USD 300.000	Morgan Stanley 2,699% 22/1/2031	232.766	0,05				
EUR 800.000	Morgan Stanley 2,95% 7/5/2032	725.712	0,15				
USD 80.000	Morgan Stanley 3,622% 1/4/2031	65.541	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 110.000	Nasdaq 5,35% 28/6/2028	101.280	0,02	USD 1.351.434	Olympic Tower 2017-OT		
USD 69.000	Nasdaq 5,65% 28/6/2025	63.651	0,01		Mortgage Trust 0,511%		
EUR 100.000	National Grid North America				10/5/2039	15.798	0,00
	1,054% 20/1/2031	80.305	0,02	USD 107.199	Olympic Tower 2017-OT		
USD 1.000.000	Nationstar Home Equity Loan				Mortgage Trust 4,077%		
	Trust 2007-B 5,839%				10/5/2039	68.016	0,01
	25/4/2037	830.940	0,16	EUR 200.000	Olympus Water US 9,625%		
USD 175.000	Nationstar Mortgage 5,125%				15/11/2028	200.341	0,04
	15/12/2030	136.268	0,03	USD 490.000	Olympus Water US 9,75%		
USD 195.000	Nationstar Mortgage 5,5%				15/11/2028	455.358	0,09
	15/8/2028	163.534	0,03	USD 100.000	Oncor Electric Delivery 2,75%		
USD 83.000	Nationstar Mortgage 5,75%				15/5/2030	79.689	0,02
	15/11/2031	65.682	0,01	USD 124.000	Oncor Electric Delivery 4,3%		
USD 317.000	Nationstar Mortgage 6%				15/5/2028	110.730	0,02
	15/1/2027	278.568	0,06	USD 150.000	Oncor Electric Delivery 4,6%		
USD 138.000	Navigent Private Education Loan				1/6/2052	123.345	0,02
	Trust 2014-A 3,5% 15/8/2044	117.365	0,02	USD 185.000	Oncor Electric Delivery 5,75%		
USD 104.000	Navigent Private Education Loan				15/3/2029	175.596	0,03
	Trust 2015-A 3,5%			USD 2.010.201	One Market Plaza Trust 2017-		
	15/12/2044	85.228	0,02		1MKT 0% 10/2/2032	62	0,00
USD 470.000	Navigent Private Education Refi			USD 127.000	OneMain Financial Issuance		
	Loan Trust 2020-H 2,95%				Trust 2019-2 3,14%		
	15/4/2069	323.424	0,06		14/10/2036	107.434	0,02
USD 50.000	Netflix 4,875% 15/4/2028	45.363	0,01	USD 130.000	OneMain Financial Issuance		
USD 50.000	Netflix 5,875% 15/2/2025	46.333	0,01		Trust 2020-2 2,76%		
USD 150.000	Netflix 5,875% 15/11/2028	142.345	0,03		14/9/2035	104.174	0,02
USD 285.404	New Century Home Equity			USD 750.000	OneMain Financial Issuance		
	Loan Trust Series 2005-C				Trust 2020-2 3,45%		
	6,104% 25/12/2035	209.619	0,04		14/9/2035	593.766	0,12
USD 47.000	New Home 8,25% 15/10/2027	41.490	0,01	USD 100.000	OneMain Financial Issuance		
USD 55.000	New Hope Cultural Education				Trust 2021-1 2,22%		
	Facilities Finance 5%				16/6/2036	77.188	0,01
	15/8/2047	51.333	0,01	USD 435.000	OneMain Financial Issuance		
USD 120.000	New Jersey Health Care				Trust 2021-1 5,94%		
	Facilities Financing Authority				16/6/2036	392.549	0,08
	3% 1/7/2051	74.868	0,01	USD 1.250.000	Option One Mortgage Loan		
USD 55.000	New Jersey Transportation				Trust 2005-4 Asset-Backed		
	Trust Fund Authority 5,754%				Certificates Series 2005-4		
	15/12/2028	51.337	0,01		6,164% 25/11/2035	944.470	0,19
USD 60.000	New Orleans Aviation Board			USD 21.586	Option One Mortgage Loan		
	5% 1/1/2040	55.325	0,01		Trust 2007-FXD1 5,866%		
USD 75.000	New York City Municipal Water				25/1/2037	15.941	0,00
	Finance Authority 5,44%			USD 19.430	Option One Mortgage Loan		
	15/6/2043	71.594	0,01		Trust 2007-FXD1 5,866%		
USD 20.000	New York City Municipal Water				25/1/2037	14.755	0,00
	Finance Authority 5,75%			USD 150.000	Oracle 1,65% 25/3/2026	125.921	0,02
	15/6/2041	19.575	0,00	USD 150.000	Oracle 2,3% 25/3/2028	121.638	0,02
USD 35.000	New York Convention Center			USD 100.000	Oracle 2,875% 25/3/2031	77.900	0,02
	Development 5% 15/11/2040	32.684	0,01	USD 100.000	Oracle 2,95% 1/4/2030	79.849	0,02
USD 275.000	New York State Urban			USD 204.000	Oracle 4,9% 6/2/2033	179.664	0,04
	Development 2,5% 15/3/2033	205.186	0,04	USD 140.000	Oracle 6,25% 9/11/2032	134.983	0,03
USD 96.000	Nexstar Media 4,75% 1/11/2028	77.731	0,02	USD 34.137	Oregon School Boards		
USD 133.000	Nexstar Media 5,625%				Association 4,759%		
	15/7/2027	115.362	0,02		30/6/2028	30.968	0,01
USD 150.000	NextEra Energy Capital 1,9%			USD 90.000	Oregon School Boards		
	15/6/2028	118.706	0,02		Association 5,55% 30/6/2028	83.713	0,02
USD 75.000	NextEra Energy Capital			EUR 100.000	Organon & Co / Organon		
	4,625% 15/7/2027	67.389	0,01		Foreign Debt Co-Issuer		
USD 235.000	NextEra Energy Capital				2,875% 30/4/2028	88.985	0,02
	5,749% 1/9/2025	217.220	0,04	USD 455.828	Origen Manufactured Housing		
USD 52.000	NextEra Energy Capital				Contract Trust 2007-B		
	6,051% 1/3/2025	48.109	0,01		6,625% 15/10/2037	409.037	0,08
USD 70.737	Nomura Asset Acceptance			USD 12.000	Outfront Media Capital /		
	Alternative Loan Trust Series				Outfront Media Capital		
	2005-AP1 6,046% 25/2/2035	62.233	0,01		4,625% 15/3/2030	9.000	0,00
USD 410.000	Northern States Power 2,9%			USD 15.000	Outfront Media Capital /		
	1/3/2050	249.284	0,05		Outfront Media Capital 5%		
USD 340.000	NVIDIA 2,85% 1/4/2030	281.324	0,06		15/8/2027	12.527	0,00
USD 320.614	Oakwood Mortgage Investors			USD 110.000	Owens-Brockway Glass		
	7,475% 15/8/2027	239.471	0,05		Container 7,25% 15/5/2031	101.940	0,02

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 310.000	Paramount Global 6,375% 30/3/2062	236.341	0,05	USD 500.000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052	496.351	0,10
USD 283.000	Park Intermediate / PK Domestic Property / PK Finance Co-Issuer 4,875% 15/5/2029	226.516	0,05	USD 796.000	San Diego Gas & Electric 4,95% 15/8/2028	726.707	0,14
USD 205.000	Parker-Hannifin 3,25% 14/6/2029	170.747	0,03	USD 45.000	San Diego Public Facilities Financing Authority 5% 15/5/2039	43.219	0,01
USD 175.000	Parker-Hannifin 3,65% 15/6/2024	158.554	0,03	USD 200.000	Sasol Financing USA 6,5% 27/9/2028	167.337	0,03
USD 75.000	PECO Energy 3% 15/9/2049	46.165	0,01	USD 1.022.545	Saxon Asset Trust 2007-1 5,719% 25/1/2047	853.317	0,17
USD 100.000	PECO Energy 4,6% 15/5/2052	81.031	0,02	EUR 200.000	SCIL IV / SCIL USA 9,5% 15/7/2028	203.561	0,04
USD 20.000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	18.491	0,00	USD 200.000	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2006-OP1 6,434% 25/10/2035	134.632	0,03
USD 100.000	Pfizer 2,55% 28/5/2040	66.146	0,01	USD 42.836	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2007-BR1 5,649% 25/2/2037	16.748	0,00
USD 155.000	Pfizer 2,625% 1/4/2030	125.676	0,02	USD 456.553	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2007-BR1 5,969% 25/2/2037	178.491	0,03
USD 213.000	Pilgrim's Pride 6,25% 1/7/2033	195.140	0,04	USD 454.000	Select Medical 6,25% 15/8/2026	414.813	0,08
USD 600.000	Pitney Bowes 6,875% 15/3/2027	419.413	0,08	USD 147.000	Sempra 3,7% 1/4/2029	123.632	0,02
USD 787.000	PNC Financial Services 4,758% 26/1/2027	711.722	0,14	USD 707.990	Sequoia Mortgage Trust 2007-3 3,922% 20/7/2037	525.424	0,10
USD 40.000	Port of Seattle WA 5% 1/5/2043	37.414	0,01	USD 336.000	Sesac Finance 5,216% 25/7/2049	293.541	0,06
USD 100.000	PPG Industries 1,2% 15/3/2026	83.160	0,02	USD 75.000	Sherwin-Williams 3,45% 1/8/2025	66.540	0,01
USD 67.000	Prologis 2,25% 15/1/2032	49.598	0,01	USD 25.000	Sherwin-Williams 3,95% 15/1/2026	22.297	0,00
USD 147.000	Prologis 4,875% 15/6/2028	133.899	0,03	USD 72.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	61.280	0,01
USD 1.400.000	Public Service Electric and Gas 4,65% 15/3/2033	1.251.342	0,25	USD 195.000	Sirius XM Radio 5,5% 1/7/2029	162.126	0,03
USD 51.000	Rain Carbon 12,25% 1/9/2029	48.605	0,01	USD 725.795	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10,175% 15/10/2041	707.952	0,14
USD 310.000	Rand Parent 8,5% 15/2/2030*	272.775	0,05	USD 165.000	SMB Private Education Loan Trust 2014-A 4,5% 15/9/2045	129.582	0,02
USD 1.148.367	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7,867% 25/10/2039	1.059.194	0,21	USD 240.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2,5% 15/9/2054	175.097	0,03
USD 204.615	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 7,782% 25/6/2037	188.957	0,04	USD 140.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 3,2% 15/9/2054	104.302	0,02
EUR 100.000	Realty Income 5,125% 6/7/2034	100.287	0,02	USD 350.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2,5% 15/9/2054	257.330	0,05
USD 85.000	Regal Rexnord 6,05% 15/2/2026	77.960	0,02	USD 777.633	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2,99% 15/1/2053	596.316	0,12
USD 100.000	Republic Services 2,5% 15/8/2024	89.336	0,02	USD 122.000	Sofi Professional Loan Program 2018-A 3,61% 25/2/2042	100.676	0,02
USD 50.000	Republic Services 2,9% 1/7/2026	43.314	0,01	USD 155.000	Southern California Edison 2,75% 1/2/2032	118.186	0,02
USD 50.000	Republic Services 3,375% 15/11/2027	42.840	0,01	USD 40.000	Southern California Edison 2,85% 1/8/2029	32.427	0,01
USD 73.000	Republic Services 4,875% 1/4/2029	66.307	0,01	USD 125.000	Southern California Edison 3,65% 1/6/2051	82.422	0,02
USD 328.152	RFMSI Series 2006-SA2 Trust 5,341% 25/8/2036	214.857	0,04	USD 150.000	Southern California Edison 4,7% 1/6/2027	135.893	0,03
USD 17.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	14.548	0,00	USD 75.000	Southern California Edison 5,3% 1/3/2028	69.321	0,01
USD 165.000	RingCentral 8,5% 15/8/2030	150.038	0,03	USD 65.000	Southern California Edison 5,95% 1/11/2032	62.140	0,01
USD 212.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	173.859	0,03	USD 1.775.000	Southern Power 0,9% 15/1/2026	1.476.670	0,29
USD 715.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,625% 1/3/2029	562.268	0,11	USD 787.000	Sprint 7,875% 15/9/2023	724.900	0,14
USD 478.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,875% 1/3/2031	357.385	0,07	USD 75.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	63.727	0,01
USD 75.000	Roper Technologies 2,95% 15/9/2029	61.057	0,01				
USD 75.000	Roper Technologies 3,8% 15/12/2026	65.955	0,01				
USD 153.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	138.752	0,03				
USD 32.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	29.085	0,01				
USD 145.000	Sabre GLBL 11,25% 15/12/2027	127.494	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
USD 24.000	Standard Industries 5% 15/2/2027	21.045	0,00	USD 125.000	T-Mobile USA 2,7% 15/3/2032	93.837	0,02
USD 55.000	State of California 7,3% 1/10/2039	60.016	0,01	USD 100.000	T-Mobile USA 2,875% 15/2/2031	77.467	0,02
USD 30.000	State of California 7,35% 1/11/2039	32.890	0,01	USD 340.000	T-Mobile USA 3,375% 15/4/2029	280.989	0,06
USD 25.000	State of California 7,5% 1/4/2034	27.572	0,01	USD 75.000	T-Mobile USA 3,5% 15/4/2031	60.384	0,01
USD 60.000	State of California 7,55% 1/4/2039	67.945	0,01	USD 290.000	T-Mobile USA 3,875% 15/4/2030	243.790	0,05
USD 160.000	State of Georgia 4% 1/7/2040	149.863	0,03	USD 155.000	Toyota Motor Credit 4,45% 18/5/2026	140.816	0,03
USD 160.000	State of Georgia 4% 1/7/2041	149.309	0,03	USD 191.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	167.856	0,03
USD 220.000	State of Minnesota 4% 1/9/2038	206.551	0,04	USD 12.000	Tri Pointe Homes 5,7% 15/6/2028	10.466	0,00
USD 150.000	State of New York 2,8% 15/2/2032	119.406	0,02	USD 125.000	Truist Financial 5,867% 8/6/2034	114.251	0,02
USD 50.000	State of Oregon 5,892% 1/6/2027	46.939	0,01	USD 175.000	Tyson Foods 3,95% 15/8/2024	158.423	0,03
USD 110.000	State of Washington 5% 1/8/2040	102.992	0,02	USD 75.000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C12 4,788% 15/8/2051	58.598	0,01
USD 45.000	State of Washington 5% 1/8/2040	43.228	0,01	EUR 100.000	UGI International 2,5% 1/12/2029	78.233	0,02
USD 338.000	State Street 6,552% 15/6/2047	254.555	0,05	USD 892.600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2026	897.131	0,18
USD 280.000	Steel Dynamics 3,45% 15/4/2030	229.107	0,05	USD 292.100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/10/2026	280.931	0,06
USD 69.000	Stem 0,5% 1/12/2028	38.829	0,01	USD 405.500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2027	373.139	0,07
USD 806.262	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 6% 25/10/2036	420.327	0,08	USD 7.031.100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,5% 15/4/2024	7.670.810	1,51
USD 271.106	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF4 6% 25/10/2036	138.930	0,03	USD 6.727.200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/1/2024	7.997.807	1,58
USD 35.000	Sumter Landing Community Development District 4,172% 1/10/2047	28.384	0,01	USD 2.312.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,625% 15/7/2032	2.008.960	0,40
USD 293.000	Sunoco / Sunoco Finance 4,5% 30/4/2030	240.877	0,05	USD 36.600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	31.160	0,01
USD 221.000	Sunoco / Sunoco Finance 5,875% 15/3/2028	197.422	0,04	USD 2.459.700	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,625% 15/10/2027	2.288.523	0,45
USD 356.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	322.729	0,06	USD 272.000	United States Treasury Note/ Bond 1,125% 15/2/2031	203.535	0,04
USD 115.000	TEGNA 4,625% 15/3/2028	95.187	0,02	USD 213.000	United States Treasury Note/ Bond 1,25% 30/6/2028	170.349	0,03
USD 25.000	TEGNA 5% 15/9/2029	20.340	0,00	USD 357.000	United States Treasury Note/ Bond 1,625% 15/8/2029	284.717	0,06
USD 11.000	Teleflex 4,625% 15/11/2027	9.518	0,00	USD 87.200	United States Treasury Note/ Bond 1,625% 15/11/2050	46.541	0,01
USD 631.000	Tenet Healthcare 4,25% 1/6/2029	520.076	0,10	USD 436.000	United States Treasury Note/ Bond 1,875% 15/11/2051	247.115	0,05
USD 408.000	Tenet Healthcare 4,375% 15/1/2030	333.535	0,07	USD 495.000	United States Treasury Note/ Bond 2% 15/8/2051	289.893	0,06
USD 136.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	121.561	0,02	USD 110.000	United States Treasury Note/ Bond 2,25% 15/8/2049	69.023	0,01
USD 150.000	Tenneco 8% 17/11/2028	113.765	0,02	USD 757.000	United States Treasury Note/ Bond 2,25% 15/2/2052	471.132	0,09
USD 30.000	Tennessee Housing Development Agency 3,75% 1/7/2038	26.024	0,01	USD 7.000	United States Treasury Note/ Bond 2,375% 15/5/2051	4.488	0,00
USD 15.000	Tennessee Housing Development Agency 3,85% 1/7/2043	13.059	0,00	USD 260.400	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/5/2032	218.027	0,04
USD 15.000	Tennessee Housing Development Agency 3,95% 1/1/2049	13.121	0,00	USD 7.813.900	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/5/2052	5.594.862	1,10
USD 80.000	Texas A&M University 2,836% 15/5/2027	69.322	0,01	USD 9.604.400	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/8/2052	7.060.849	1,39
USD 25.000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation 5% 31/12/2055	22.535	0,00				
USD 200.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	173.674	0,04				
USD 125.000	T-Mobile USA 1,5% 15/2/2026	104.942	0,02				
USD 150.000	T-Mobile USA 2,05% 15/2/2028	120.631	0,02				
USD 200.000	T-Mobile USA 2,4% 15/3/2029	158.297	0,03				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net			Valeur de marché (EUR)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 4.654.200	United States Treasury Note/ Bond 3,125% 31/8/2027	4.089.052	0,81	USD 190.399	Washington Mutual Asset- Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 4,162% 25/10/2036	130.007	0,03
USD 14.000.000	United States Treasury Note/ Bond 3,5% 15/2/2033	12.282.878	2,42	USD 180.000	Waste Management 1,15% 15/3/2028	139.989	0,03
USD 10.000.000	United States Treasury Note/ Bond 3,75% 15/4/2026	9.010.391	1,78	USD 75.000	Waste Management 2% 1/6/2029	58.572	0,01
USD 1.109.200	United States Treasury Note/ Bond 4% 15/11/2052	987.132	0,20	USD 235.000	Waste Management 4,875% 15/2/2034	211.343	0,04
USD 121.000	United States Treasury Note/ Bond 4,125% 15/8/2053	110.089	0,02	USD 69.000	Weekley Homes / Weekley Finance 4,875% 15/9/2028	56.287	0,01
USD 2.800.000	United States Treasury Note/ Bond 4,25% 30/9/2024	2.551.068	0,50	EUR 450.000	Wells Fargo 1,741% 4/5/2030	390.998	0,08
USD 358.000	United Wholesale Mortgage 5,5% 15/11/2025	317.201	0,06	GBP 200.000	Wells Fargo 3,473% 26/4/2028*	210.056	0,04
USD 150.000	UnitedHealth 2,3% 15/5/2031	115.594	0,02	USD 233.000	Wells Fargo 5,574% 25/7/2029	213.727	0,04
USD 198.000	UnitedHealth 3,875% 15/12/2028	174.721	0,03	USD 27.487	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 4,224% 15/12/2048	23.379	0,00
USD 100.000	UnitedHealth 4,2% 15/5/2032	87.109	0,02	USD 126.439	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 1,389% 15/8/2049	3.516	0,00
USD 450.000	UnitedHealth 4,25% 15/1/2029	401.925	0,08	USD 21.531	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5,111% 15/1/2059	18.512	0,00
USD 475.000	UnitedHealth 5,35% 15/2/2033	449.645	0,09	USD 60.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 4,188% 15/11/2050	45.266	0,01
USD 182.000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	167.197	0,03	USD 110.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 4,002% 15/12/2050	84.042	0,02
USD 55.000	University of California 5,77% 15/5/2043	53.256	0,01	USD 66.448	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 4,727% 15/6/2051	50.349	0,01
USD 125.000	US Bancorp 5,836% 12/6/2034	115.099	0,02	USD 106.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C46 4,633% 15/8/2051	84.447	0,02
USD 150.000	Verizon Communications 3,15% 22/3/2030	121.244	0,02	USD 1.205.000	Welltower 2,7% 15/2/2027	1.018.500	0,20
USD 2.000.000	Verizon Communications 3,875% 8/2/2029	1.719.763	0,34	USD 54.000	Wesleyan University 4,781% 1/7/2116	39.667	0,01
USD 25.000	Verizon Communications 4,016% 3/12/2029	21.388	0,01	USD 40.000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2024	37.213	0,01
USD 20.000	Viasat 5,625% 15/9/2025	17.410	0,00	USD 23.822	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 4,204% 15/11/2047	20.388	0,00
USD 61.000	Viasat 5,625% 15/4/2027	50.248	0,01	USD 198.000	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-3 3,978% 20/11/2044	162.285	0,03
USD 35.000	VICI Properties / VICI Note 5,625% 1/5/2024	32.036	0,01	USD 462.103	WinWater Mortgage Loan Trust 2015-5 3,752% 20/8/2045	265.849	0,05
USD 105.000	Virginia Small Business Financing Authority 5% 31/12/2052	95.745	0,02	EUR 141.000	WMG Acquisition 2,25% 15/8/2031	113.408	0,02
USD 50.000	VMware 2,2% 15/8/2031	35.942	0,01	USD 150.000	Workday 3,7% 1/4/2029	127.647	0,02
USD 220.000	VMware 4,65% 15/5/2027	197.097	0,04	USD 750.000	Xerox 5% 15/8/2025	659.746	0,13
USD 672.000	VMware 4,7% 15/5/2030	584.218	0,12	USD 70.000	XHR 4,875% 1/6/2029	55.885	0,01
USD 100.000	Walt Disney 1,75% 30/8/2024	88.803	0,02	USD 51.000	XHR 6,375% 15/8/2025	46.473	0,01
USD 200.000	Walt Disney 2% 1/9/2029	156.422	0,03	USD 340.000	Xylem 1,95% 30/1/2028	274.855	0,05
USD 50.000	Walt Disney 3,8% 22/3/2030	43.167	0,01	USD 1.726.865	Yale Mortgage Loan Trust 2007- 1 5,829% 25/6/2037	520.888	0,10
USD 172.633	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 5,18% 25/6/2047	128.577	0,03			218.468.665	43,11
USD 632.074	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 5,228% 25/6/2047	448.780	0,09	Uruguay			
USD 90.000	Warnermedia 6,412% 15/3/2026	83.086	0,02	USD 165.092	Uruguay Government International Bond 5,75% 28/10/2034	163.465	0,03
USD 81.031	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5,5% 25/11/2035	51.319	0,01	Total des obligations			418.788.301 82,63
USD 32.166	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5,5% 25/11/2035	22.562	0,00	BILLET DE TRÉSORERIE			
USD 963.219	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA1 Trust 5,15% 25/12/2046	714.695	0,14	France			
USD 308.260	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA3 Trust 5,68% 25/4/2047	240.226	0,05	USD 459.000	Societe Generale 0% 6/3/2024	410.552	0,08

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
BRL	344.975	USD	70.000	BNP Paribas	5/9/2023	8
BRL	623.490	USD	126.507	Citigroup	20/9/2023	(264)
BRL	344.792	USD	69.000	JP Morgan	5/9/2023	895
BRL	532.000	USD	108.722	Barclays	14/9/2023	(846)
BRL	803.827	USD	163.549	JP Morgan	20/9/2023	(756)
BRL	2.032.748	USD	414.000	HSBC Bank	3/10/2023	(3.092)
BRL	1.327.632	USD	272.000	Citigroup	3/10/2023	(3.500)
CAD	133.536	USD	100.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(1.169)
CAD	469.244	USD	350.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(2.819)
CAD	222.334	USD	168.422	Bank of America	20/9/2023	(3.718)
CAD	255.380	USD	193.500	Citigroup	20/9/2023	(4.313)
CAD	558.174	USD	422.500	BNP Paribas	20/9/2023	(9.034)
CAD	337.121	USD	250.000	HSBC Bank	20/9/2023	(688)
CAD	197.915	USD	150.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(3.380)
CAD	532.310	USD	400.000	JP Morgan	20/9/2023	(5.923)
CAD	66.805	USD	50.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(560)
CAD	578.356	EUR	394.000	UBS	18/9/2023	(146)
CAD	9.426	USD	7.000	Deutsche Bank	18/9/2023	(29)
CAD	185.198	USD	136.000	JP Morgan	18/9/2023	851
CAD	188.000	JPY	20.237.818	JP Morgan	15/9/2023	254
CHF	89.254	USD	100.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.134
CHF	175.932	USD	200.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(421)
CHF	88.222	USD	100.000	HSBC Bank	20/9/2023	57
CHF	88.655	USD	100.000	JP Morgan	20/9/2023	509
CHF	43.009	USD	50.000	BNP Paribas	20/9/2023	(1.122)
CHF	130.533	USD	150.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(1.794)
CHF	43.527	USD	50.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(581)
CHF	217.842	USD	250.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.691)
CLP	542.194.450	USD	623.000	Citigroup	15/9/2023	9.895
CLP	59.829.900	USD	69.000	BNP Paribas	15/9/2023	859
CLP	142.874.000	USD	164.791	BNP Paribas	14/9/2023	2.052
CLP	94.877.000	USD	109.634	Toronto-Dominion	14/9/2023	1.176
CLP	355.720.500	USD	411.000	Toronto-Dominion	15/9/2023	4.407
CLP	294.475.168	USD	342.000	JP Morgan	15/9/2023	2.023
CLP	94.877.000	USD	109.913	JP Morgan	14/9/2023	919
CLP	58.347.296	USD	69.000	Goldman Sachs	15/9/2023	(738)
CLP	58.431.720	USD	68.000	Barclays	15/9/2023	274
CNH	2.020.000	USD	285.925	Citigroup	14/9/2023	(7.491)
CNH	319.251	USD	44.753	Toronto-Dominion	20/9/2023	(769)
CNH	4.095.000	USD	568.449	JP Morgan	14/9/2023	(4.881)
CNH	1.357.540	USD	189.814	BNP Paribas	21/9/2023	(2.814)
CNH	1.148.324	USD	161.713	Credit Agricole	20/9/2023	(3.449)
CNH	229.238	USD	32.287	JP Morgan	20/9/2023	(693)
CNH	417.208	USD	57.038	BNP Paribas	20/9/2023	327
CNH	324.468	USD	44.362	Bank of America	20/9/2023	252
COP	2.592.420.496	USD	610.900	BNY Mellon	20/12/2023	2.649
COP	2.020.928.456	USD	474.842	BNY Mellon	14/9/2023	14.439
COP	1.587.812.000	USD	390.720	Bank of America	14/9/2023	(4.910)
COP	1.183.806.000	GBP	234.000	Citigroup	18/9/2023	(8.936)
COP	2.750.935.000	USD	636.349	Morgan Stanley	15/8/2024	(10.052)
COP	1.141.900.000	USD	260.173	BNP Paribas	17/5/2024	2.541
COP	3.131.221.500	USD	755.000	Citigroup	18/9/2023	3.676
COP	900.508.000	USD	217.464	Citigroup	14/9/2023	1.018
COP	1.128.332.000	USD	274.000	Bank of America	18/9/2023	(460)
COP	896.985.000	USD	215.777	Toronto-Dominion	29/9/2023	778
CZK	5.300.727	USD	240.010	Toronto-Dominion	14/9/2023	(959)
CZK	11.354.513	USD	530.536	UBS	14/9/2023	(17.181)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
CZK	11.034.349	USD	506.456	Morgan Stanley	14/9/2023	(8.294)
CZK	2.606.146	USD	119.647	Morgan Stanley	6/9/2023	(1.953)
CZK	21.627.268	USD	978.000	Barclays	18/9/2023	(2.902)
EUR	285.764	GBP	246.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(1.460)
EUR	3.091.166	GBP	2.658.633	Bank of America	20/9/2023	(13.003)
EUR	5.651.140	USD	6.260.161	JP Morgan	20/9/2023	(114.419)
EUR	1.254.254	JPY	192.114.000	Citigroup	20/9/2023	40.548
EUR	181.050	USD	199.114	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(2.333)
EUR	388.554	AUD	621.000	Nomura	20/9/2023	17.863
EUR	57.277	GBP	49.000	Nomura	20/9/2023	65
EUR	321.388.498	USD	352.678.281	BNP Paribas	20/9/2023	(3.425.325)
EUR	33.062.291	GBP	28.331.438	JP Morgan	20/9/2023	(16.952)
EUR	41.896	GBP	36.000	UBS	20/9/2023	(137)
EUR	5.369.675	USD	5.902.687	HSBC Bank	20/9/2023	(66.652)
EUR	188.603	NOK	2.213.000	Bank of America	20/9/2023	(2.891)
EUR	129.987	SGD	191.000	HSBC Bank	20/9/2023	(246)
EUR	1.712.041	SEK	20.209.000	Bank of America	20/9/2023	4.584
EUR	201.160	HKD	1.729.000	HSBC Bank	20/9/2023	(2.033)
EUR	136.000	SEK	1.596.531	UBS	20/9/2023	1.109
EUR	1.705.900	USD	1.879.548	Citigroup	20/9/2023	(25.148)
EUR	257.000	SEK	3.009.667	Morgan Stanley	20/9/2023	2.714
EUR	1.150.000	USD	1.257.506	Deutsche Bank	20/9/2023	(8.154)
EUR	91.768	USD	100.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(332)
EUR	68.408	GBP	59.000	BNP Paribas	20/9/2023	(479)
EUR	840.000	USD	912.181	Credit Agricole	20/9/2023	(112)
EUR	430.000	GBP	368.536	HSBC Bank	20/9/2023	(295)
EUR	25.958	NOK	300.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(1)
EUR	191.059	SEK	2.249.513	Goldman Sachs	20/9/2023	998
EUR	17.899	NOK	200.000	Deutsche Bank	20/9/2023	593
EUR	194.000	USD	216.678	JP Morgan	21/9/2023	(5.549)
EUR	383.187	AUD	624.304	Citibank	21/9/2023	10.529
EUR	511.000	USD	567.724	Barclays	14/9/2023	(12.021)
EUR	247.000	GBP	212.011	Goldman Sachs	20/9/2023	(540)
EUR	191.027	SEK	2.229.278	JP Morgan	20/9/2023	2.675
EUR	386.536	AUD	635.996	Morgan Stanley	20/9/2023	6.894
EUR	300.988	USD	327.438	Goldman Sachs	20/9/2023	(580)
EUR	194.000	USD	213.418	HSBC Bank	21/9/2023	(2.547)
EUR	165.000	SEK	1.925.532	BNP Paribas	20/9/2023	2.312
EUR	20.278	HUF	8.000.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(672)
EUR	559.771	USD	607.919	Toronto-Dominion	20/9/2023	(117)
EUR	85.402	USD	94.008	Bank of America	20/9/2023	(1.179)
EUR	769.983	USD	850.000	BNY Mellon	20/9/2023	(12.860)
EUR	182.371	USD	200.000	Barclays	20/9/2023	(1.827)
EUR	127.297	AUD	213.148	Deutsche Bank	20/9/2023	63
EUR	190.946	AUD	320.320	Citigroup	20/9/2023	(261)
EUR	1.295.918	USD	1.426.000	Westpac	20/9/2023	(17.416)
EUR	23.216	HUF	9.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(353)
EUR	40.000	PLN	178.558	HSBC Bank	18/9/2023	104
EUR	502.000	USD	547.324	Citigroup	18/9/2023	(2.130)
EUR	318.243	AUD	538.015	Bank of America	20/9/2023	(2.912)
EUR	318.000	USD	343.436	JP Morgan	18/9/2023	1.666
GBP	1.300.956	USD	1.676.757	JP Morgan	20/9/2023	(25.308)
GBP	3.051.643	EUR	3.553.835	HSBC Bank	20/9/2023	9.205
GBP	109.481	USD	139.808	Deutsche Bank	20/9/2023	(934)
GBP	389.282	USD	499.877	HSBC Bank	20/9/2023	(5.865)
GBP	39.291	USD	50.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(174)
GBP	585.952	EUR	677.000	Deutsche Bank	20/9/2023	7.146

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
GBP	435.148	USD	557.599	BNP Paribas	20/9/2023	(5.475)
GBP	90.444	USD	116.931	Morgan Stanley	20/9/2023	(2.091)
GBP	110.128	USD	140.928	Barclays	20/9/2023	(1.210)
GBP	180.000	USD	230.610	JP Morgan	13/9/2023	(2.233)
GBP	212.677	EUR	247.000	JP Morgan	20/9/2023	1.317
GBP	543.315	EUR	630.000	Bank of America	20/9/2023	4.364
GBP	39.254	USD	50.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(217)
GBP	494.000	USD	625.102	JP Morgan	18/9/2023	1.066
HUF	250.490.113	USD	710.429	JP Morgan	14/9/2023	2.500
HUF	25.000.000	EUR	64.211	Deutsche Bank	20/9/2023	1.259
HUF	8.000.000	EUR	20.505	JP Morgan	20/9/2023	445
HUF	9.000.000	EUR	22.628	BNP Paribas	20/9/2023	941
HUF	99.244.003	USD	279.000	Deutsche Bank	18/9/2023	3.052
HUF	58.126.000	USD	164.621	Citigroup	14/9/2023	795
IDR	2.800.000.000	USD	187.567	Bank of America	20/9/2023	(3.461)
IDR	23.435.752.230	EUR	1.452.029	HSBC Bank	20/9/2023	(35.112)
IDR	8.505.085.000	USD	567.384	JP Morgan	14/9/2023	(8.298)
IDR	4.270.000.000	USD	283.796	Barclays	20/9/2023	(3.211)
IDR	7.494.550.000	USD	490.000	Barclays	18/9/2023	1.846
IDR	6.037.819.040	USD	393.651	Barclays	26/9/2023	2.462
IDR	9.958.637.815	USD	649.575	Citigroup	20/9/2023	3.842
IDR	5.503.133.496	USD	359.705	HSBC Bank	14/9/2023	1.462
INR	57.700.000	USD	695.779	Barclays	20/9/2023	1.078
INR	104.189.000	USD	1.257.777	Citigroup	14/9/2023	668
INR	66.847.761	USD	810.000	Citigroup	20/9/2023	(2.354)
INR	22.647.000	USD	274.210	BNP Paribas	14/9/2023	(605)
INR	33.922.990	USD	410.000	Citigroup	18/9/2023	(228)
JPY	18.930.613	USD	134.317	Deutsche Bank	20/9/2023	(4.107)
JPY	27.000.000	USD	189.371	Bank of America	20/9/2023	(3.833)
JPY	17.304.129	USD	123.730	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(4.632)
JPY	32.426.181	USD	228.878	Goldman Sachs	20/9/2023	(5.938)
JPY	169.872.336	USD	1.219.848	Nomura	20/9/2023	(50.278)
JPY	27.459.723	USD	195.166	Toronto-Dominion	20/9/2023	(6.265)
JPY	266.672.969	USD	1.891.088	JP Morgan	20/9/2023	(56.934)
JPY	49.986.283	USD	351.376	BNP Paribas	20/9/2023	(7.820)
JPY	29.500.000	USD	206.729	HSBC Bank	20/9/2023	(4.025)
JPY	64.610.067	USD	469.688	Morgan Stanley	20/9/2023	(24.397)
JPY	17.449.359	USD	127.000	Citigroup	20/9/2023	(6.727)
JPY	14.251.940	USD	102.058	Citibank	20/9/2023	(3.956)
JPY	14.410.698	USD	100.000	Credit Agricole	20/9/2023	(1.058)
JPY	33.942.965	EUR	215.000	HSBC Bank	15/9/2023	(680)
JPY	40.217.840	USD	278.000	HSBC Bank	15/9/2023	(2.158)
JPY	20.187.791	CAD	188.000	JP Morgan	15/9/2023	(570)
JPY	20.000.878	USD	138.000	JP Morgan	15/9/2023	(840)
JPY	12.000.000	USD	82.499	Barclays	20/9/2023	(170)
KRW	32.191.750	USD	25.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(590)
KRW	368.865.000	USD	282.793	Citigroup	14/9/2023	(3.402)
KRW	374.185.800	USD	282.000	Citigroup	18/9/2023	1.048
MXN	72.053.700	USD	4.121.629	Barclays	20/9/2023	158.290
MXN	13.241.851	USD	781.475	JP Morgan	20/9/2023	6.976
MXN	1.101.762	USD	63.012	BNP Paribas	20/9/2023	2.431
MXN	7.304.088	GBP	336.000	JP Morgan	18/9/2023	8.682
MXN	4.807.896	USD	280.000	JP Morgan	15/9/2023	6.208
MXN	15.064	USD	875	Morgan Stanley	14/9/2023	21
MXN	14.088.518	USD	830.000	Goldman Sachs	18/9/2023	9.019
MXN	2.159.130	USD	128.000	Toronto-Dominion	18/9/2023	646
MYR	1.015.949	USD	225.017	Barclays	14/9/2023	(5.440)
MYR	2.572.836	USD	562.000	Barclays	18/9/2023	(6.402)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
NOK	2.903.007	USD	264.014	Deutsche Bank	14/9/2023	8.000
NOK	4.450.000	USD	423.938	Barclays	20/9/2023	(5.381)
NOK	3.035.591	USD	287.336	Toronto-Dominion	20/9/2023	(1.960)
NOK	5.324.212	USD	504.028	Goldman Sachs	20/9/2023	(3.496)
NOK	440.000	USD	41.263	Citigroup	20/9/2023	70
NOK	648.667	USD	60.506	HSBC Bank	20/9/2023	404
NOK	11.049.966	USD	1.062.468	JP Morgan	20/9/2023	(22.359)
NOK	2.648.229	USD	251.870	Morgan Stanley	20/9/2023	(2.817)
NOK	300.000	EUR	25.422	Bank of America	20/9/2023	537
NOK	5.510.590	USD	530.488	Deutsche Bank	20/9/2023	(11.737)
NOK	200.000	EUR	17.070	Goldman Sachs	20/9/2023	237
NOK	230.000	USD	22.633	Bank of America	20/9/2023	(943)
NOK	1.581.963	USD	155.695	BNP Paribas	20/9/2023	(6.505)
NOK	1.288.674	USD	128.137	Barclays	21/9/2023	(6.499)
NOK	1.289.853	USD	127.351	HSBC Bank	21/9/2023	(5.673)
NOK	515.426	USD	50.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(1.449)
NOK	2.930.869	USD	280.000	Deutsche Bank	15/9/2023	(4.308)
NOK	2.913.975	USD	274.000	Deutsche Bank	18/9/2023	(219)
NOK	1.454.087	USD	137.000	Goldman Sachs	18/9/2023	(360)
NOK	2.918.279	USD	274.000	JP Morgan	18/9/2023	154
NZD	244.278	USD	150.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(4.338)
NZD	121.481	AUD	110.000	UBS	20/9/2023	883
NZD	256.800	USD	158.575	Bank of America	20/9/2023	(5.376)
NZD	585.791	USD	359.545	JP Morgan	20/9/2023	(10.253)
NZD	351.207	USD	212.488	BNP Paribas	20/9/2023	(3.316)
NZD	271.658	USD	168.376	Toronto-Dominion	20/9/2023	(6.265)
NZD	438.120	USD	268.588	Morgan Stanley	20/9/2023	(7.374)
NZD	40.000	USD	24.559	HSBC Bank	20/9/2023	(708)
NZD	164.596	USD	100.000	UBS	20/9/2023	(1.937)
NZD	251.396	USD	150.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(439)
NZD	169.313	USD	100.000	Goldman Sachs	20/9/2023	647
PLN	1.660.000	USD	398.320	Bank of America	14/9/2023	4.108
PLN	858.970	USD	209.000	Citigroup	18/9/2023	(578)
SEK	4.245.590	USD	401.176	Deutsche Bank	20/9/2023	(10.771)
SEK	2.374.469	USD	224.177	Citigroup	20/9/2023	(5.846)
SEK	926.258	USD	86.967	Bank of America	20/9/2023	(1.836)
SEK	1.731.006	USD	161.743	JP Morgan	20/9/2023	(2.712)
SEK	3.083.359	USD	287.214	HSBC Bank	20/9/2023	(4.009)
SEK	5.368.172	USD	505.122	Morgan Stanley	20/9/2023	(11.658)
SEK	1.800.107	USD	169.409	BNP Paribas	20/9/2023	(3.933)
SEK	650.000	USD	61.234	Barclays	20/9/2023	(1.478)
SEK	1.606.806	EUR	136.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(241)
SEK	2.615.974	USD	244.923	Toronto-Dominion	20/9/2023	(4.549)
SEK	3.441.014	EUR	293.500	JP Morgan	20/9/2023	(2.770)
SEK	3.117.124	USD	288.665	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.492)
SEK	2.277.692	EUR	191.059	BNP Paribas	20/9/2023	1.383
SEK	1.477.814	EUR	128.500	UBS	20/9/2023	(3.640)
SEK	2.206.448	EUR	191.027	HSBC Bank	20/9/2023	(4.604)
SEK	535.302	USD	50.000	UBS	20/9/2023	(822)
SEK	535.950	USD	50.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(767)
SEK	120.000	USD	11.276	Credit Agricole	20/9/2023	(247)
SEK	2.950.004	USD	272.000	UBS	18/9/2023	(1.290)
SGD	371.535	USD	276.709	JP Morgan	14/9/2023	(1.587)
THB	19.430.920	USD	562.563	HSBC Bank	14/9/2023	(6.560)
THB	19.510.000	USD	565.751	Citigroup	14/9/2023	(7.414)
THB	19.500.000	USD	562.567	Citigroup	20/9/2023	(4.438)
THB	28.883.278	USD	819.500	Goldman Sachs	18/9/2023	5.960
TWD	4.400.000	USD	141.588	Citigroup	20/9/2023	(3.134)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
USD	684.656	CZK	15.107.274	Deutsche Bank	6/9/2023	3.107
USD	1.106.123	IDR	16.503.077.000	Citigroup	20/9/2023	20.960
USD	144.599	TWD	4.400.000	Barclays	20/9/2023	5.906
USD	681.309	IDR	10.141.822.751	UBS	14/9/2023	14.258
USD	565.463	CZK	12.538.999	Deutsche Bank	14/9/2023	164
USD	2.276.818	MXN	40.263.026	JP Morgan	14/9/2023	(115.026)
USD	835.442	ZAR	16.124.483	Goldman Sachs	14/9/2023	(20.216)
USD	1.076.222	COP	4.542.579.689	Citigroup	14/9/2023	(24.269)
USD	95.314	EUR	88.069	Toronto-Dominion	14/9/2023	(259)
USD	150.000	CAD	198.298	Deutsche Bank	20/9/2023	3.120
USD	1.268.115	GBP	986.487	JP Morgan	20/9/2023	16.120
USD	50.000	AUD	73.448	Deutsche Bank	20/9/2023	2.206
USD	150.000	GBP	118.453	Deutsche Bank	20/9/2023	(154)
USD	1.755.886	IDR	26.194.487.000	Barclays	20/9/2023	33.447
USD	93.553	EUR	85.742	Citigroup	14/9/2023	445
USD	402.433	SEK	4.270.000	Bank of America	20/9/2023	9.866
USD	270.507	GBP	213.000	Bank of America	20/9/2023	440
USD	159.776	SEK	1.710.178	Deutsche Bank	20/9/2023	2.660
USD	300.000	NZD	495.258	Goldman Sachs	20/9/2023	5.005
USD	50.000	CHF	44.675	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(617)
USD	100.000	JPY	14.208.144	Goldman Sachs	20/9/2023	2.337
USD	1.893.736	MXN	33.011.965	Citigroup	20/9/2023	(67.568)
USD	1.534.251	EUR	1.407.896	Royal Bank of Canada	20/9/2023	5.138
USD	1.133.159	CNH	8.060.200	Toronto-Dominion	20/9/2023	22.439
USD	250.000	AUD	382.730	Royal Bank of Canada	20/9/2023	1.787
USD	441.326	SEK	4.702.960	Morgan Stanley	20/9/2023	9.106
USD	75.554	GBP	59.140	Toronto-Dominion	20/9/2023	534
USD	271.026	SEK	2.896.527	Citigroup	20/9/2023	4.883
USD	4.195.128	EUR	3.819.098	Toronto-Dominion	20/9/2023	44.580
USD	48.718	NOK	520.000	Citigroup	20/9/2023	(128)
USD	2.510.953	MXN	43.395.046	Goldman Sachs	20/9/2023	(68.935)
USD	200.000	NOK	2.117.468	Royal Bank of Canada	20/9/2023	972
USD	626.285	CAD	835.041	Morgan Stanley	20/9/2023	8.188
USD	177.260	AUD	257.000	Nomura	20/9/2023	9.845
USD	320.935	NZD	515.000	Nomura	20/9/2023	13.472
USD	50.000	GBP	38.912	Nomura	20/9/2023	616
USD	100.000	AUD	145.036	Citigroup	20/9/2023	5.523
USD	3.140.678	EUR	2.877.555	HSBC Bank	20/9/2023	14.983
USD	96.130	AUD	140.000	Bank of America	20/9/2023	4.965
USD	993.266	AUD	1.506.090	JP Morgan	20/9/2023	15.766
USD	216.844	JPY	30.976.195	Bank of America	20/9/2023	4.016
USD	249.381	EUR	227.037	Deutsche Bank	22/9/2023	2.619
USD	200.000	CHF	176.692	Goldman Sachs	20/9/2023	(373)
USD	500.000	CAD	662.656	JP Morgan	20/9/2023	9.264
USD	3.971.470	EUR	3.589.509	JP Morgan	20/9/2023	68.183
USD	781.920	NOK	8.249.734	JP Morgan	20/9/2023	6.283
USD	162.255	NOK	1.720.389	HSBC Bank	20/9/2023	568
USD	274.442	JPY	39.254.420	HSBC Bank	20/9/2023	4.765
USD	1.982.934	BRL	9.561.234	Goldman Sachs	20/9/2023	43.601
USD	547.328	SEK	5.779.607	JP Morgan	20/9/2023	15.766
USD	358.000	CAD	472.133	HSBC Bank	20/9/2023	8.221
USD	614.164	NOK	6.338.979	Morgan Stanley	20/9/2023	17.121
USD	999.774	ZAR	19.065.650	Citigroup	14/9/2023	(12.901)
USD	182.259	SEK	1.866.030	Toronto-Dominion	20/9/2023	10.199
USD	1.126.781	IDR	16.873.541.611	Citigroup	26/9/2023	17.673
USD	896.915	JPY	127.560.111	JP Morgan	20/9/2023	20.173
USD	388.477	NOK	4.032.930	Deutsche Bank	20/9/2023	8.811
USD	28.234.668	EUR	25.619.178	Deutsche Bank	20/9/2023	384.721

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
USD	307.627	SEK	3.319.204	Goldman Sachs	20/9/2023	2.882
USD	50.000	NZD	81.647	Citigroup	20/9/2023	1.325
USD	120.277	JPY	16.890.830	Royal Bank of Canada	20/9/2023	4.065
USD	100.000	CAD	132.239	BNP Paribas	20/9/2023	2.051
USD	662.581	EUR	601.875	BNP Paribas	20/9/2023	8.357
USD	502.657	GBP	392.383	BNP Paribas	20/9/2023	4.803
USD	1.858.141	COP	8.084.306.855	Bank of America	20/12/2023	(51.270)
USD	173.205	NOK	1.773.661	Barclays	20/9/2023	6.042
USD	229.549	GBP	180.000	JP Morgan	13/9/2023	1.255
USD	275.220	SGD	371.535	Citigroup	14/9/2023	215
USD	1.156.759	INR	95.155.000	Barclays	14/9/2023	6.799
USD	95.421	NOK	1.007.388	Bank of America	20/9/2023	713
USD	357.809	EUR	328.120	UBS	20/9/2023	1.420
USD	322.336	NOK	3.326.851	Toronto-Dominion	20/9/2023	8.994
USD	50.000	NZD	81.644	Toronto-Dominion	20/9/2023	1.327
USD	90.284	JPY	12.801.571	Toronto-Dominion	20/9/2023	2.275
USD	124.101	GBP	97.495	Morgan Stanley	20/9/2023	461
USD	200.000	NZD	325.375	JP Morgan	20/9/2023	5.965
USD	205.719	IDR	3.089.288.000	HSBC Bank	20/9/2023	2.689
USD	564.203	SGD	760.000	Morgan Stanley	20/9/2023	1.424
USD	139.631	INR	11.500.000	Goldman Sachs	20/9/2023	667
USD	50.000	AUD	74.808	Toronto-Dominion	20/9/2023	1.395
USD	102.192	GBP	80.000	Barclays	20/9/2023	711
USD	50.000	CHF	44.539	Toronto-Dominion	20/9/2023	(475)
USD	413.000	TWD	12.848.430	BNP Paribas	11/10/2023	8.440
USD	1.300.535	EUR	1.197.243	Barclays	20/9/2023	540
USD	469.000	JPY	66.662.383	Deutsche Bank	20/9/2023	10.797
USD	164.453	SEK	1.749.078	BNP Paribas	20/9/2023	3.682
USD	151.940	GBP	118.382	HSBC Bank	20/9/2023	1.716
USD	1.210.514	JPY	175.458.831	Citigroup	20/9/2023	6.388
USD	9.201	SEK	100.000	Westpac	20/9/2023	25
USD	431.199	JPY	60.399.255	BNP Paribas	20/9/2023	15.550
USD	192.449	NOK	1.992.635	Goldman Sachs	20/9/2023	4.820
USD	1.963.011	EUR	1.775.897	Citigroup	20/9/2023	32.533
USD	61.497	JPY	8.913.068	Morgan Stanley	20/9/2023	329
USD	111.242	SEK	1.186.699	UBS	20/9/2023	2.189
USD	250.000	CHF	217.914	JP Morgan	20/9/2023	2.616
USD	25.000	KRW	31.873.100	Morgan Stanley	20/9/2023	812
USD	50.885	JPY	7.030.000	Barclays	20/9/2023	2.452
USD	205.305	PHP	11.300.000	Citigroup	20/9/2023	5.352
USD	189.814	CNH	1.354.665	Citigroup	21/9/2023	3.178
USD	220.062	NZD	361.959	Morgan Stanley	20/9/2023	4.401
USD	150.000	CHF	130.483	Morgan Stanley	20/9/2023	1.847
USD	370.304	AUD	550.749	HSBC Bank	20/9/2023	12.291
USD	149.691	AUD	225.716	BNP Paribas	20/9/2023	3.128
USD	194.000	CNH	1.383.476	BNP Paribas	20/9/2023	3.392
USD	74.794	NZD	119.974	HSBC Bank	20/9/2023	3.166
USD	50.000	NZD	80.240	BNP Paribas	20/9/2023	2.096
USD	288.191	NOK	2.903.007	Barclays	14/9/2023	14.273
USD	1.153.580	MXN	19.781.013	HSBC Bank	20/9/2023	(23.136)
USD	942.027	CZK	20.690.003	Barclays	14/9/2023	8.545
USD	250.503	GBP	194.000	Citibank	20/9/2023	4.201
USD	332.861	HUF	116.545.000	Bank of America	14/9/2023	975
USD	1.134.070	BRL	5.545.906	BNY Mellon	14/9/2023	9.441
USD	19.654	SEK	210.000	Credit Agricole	20/9/2023	358
USD	128.137	NOK	1.279.774	Morgan Stanley	21/9/2023	7.269
USD	250.000	CAD	334.962	Goldman Sachs	20/9/2023	2.158
USD	32.965	EUR	30.000	Bank of America	20/9/2023	361

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
USD	98.740	NOK	1.029.062	BNP Paribas	20/9/2023	1.893
USD	1.125.194	IDR	17.110.390.260	Morgan Stanley	20/9/2023	1.806
USD	50.000	CAD	66.685	Toronto-Dominion	20/9/2023	641
USD	428.322	EUR	388.000	Citigroup	21/9/2023	6.461
USD	333.463	IDR	5.083.639.000	Citigroup	14/9/2023	(266)
USD	127.351	NOK	1.300.859	JP Morgan	21/9/2023	4.721
USD	50.000	GBP	39.376	UBS	20/9/2023	75
USD	150.000	AUD	228.350	Goldman Sachs	20/9/2023	1.841
USD	387.784	PLN	1.585.000	JP Morgan	14/9/2023	2.950
USD	438.898	MXN	7.609.000	Citigroup	14/9/2023	(13.797)
USD	50.000	CHF	43.581	UBS	20/9/2023	525
USD	273.174	BRL	1.335.000	Goldman Sachs	14/9/2023	2.441
USD	50.000	JPY	7.067.365	UBS	20/9/2023	1.401
USD	50.000	NOK	512.484	UBS	20/9/2023	1.704
USD	918.508	ZAR	17.329.335	Toronto-Dominion	7/11/2023	1.427
USD	295.365	EUR	268.733	UBS	7/11/2023	2.646
USD	542.611	MXN	9.263.418	Barclays	14/9/2023	(9.166)
USD	150.000	EUR	136.810	Morgan Stanley	20/9/2023	1.339
USD	63.012	MXN	1.089.984	BNP Paribas	20/9/2023	(1.784)
USD	134.036	COP	566.972.581	Citigroup	20/12/2023	(185)
USD	150.000	NZD	251.115	Royal Bank of Canada	20/9/2023	593
USD	37.773	CZK	837.864	UBS	6/9/2023	(11)
USD	70.000	COP	287.379.400	Barclays	18/9/2023	314
USD	50.000	CAD	67.131	Citigroup	20/9/2023	337
USD	100.000	GBP	78.484	Goldman Sachs	20/9/2023	462
USD	107.944	AUD	164.840	Morgan Stanley	20/9/2023	1.018
USD	489.000	COP	1.965.175.500	Citigroup	18/9/2023	11.655
USD	488.889	AUD	751.925	Barclays	20/9/2023	1.420
USD	200.000	CHF	174.789	Barclays	20/9/2023	1.614
USD	70.000	BRL	342.661	Credit Agricole	5/9/2023	425
USD	497.964	CNH	3.610.000	Citigroup	14/9/2023	1.392
USD	50.000	SEK	529.203	Barclays	20/9/2023	1.337
USD	452.975	BRL	2.208.387	Citigroup	20/9/2023	5.440
USD	32.000	CLP	27.305.600	Morgan Stanley	15/9/2023	78
USD	280.000	CLP	239.008.000	BNP Paribas	15/9/2023	586
USD	683.632	COP	2.750.935.000	Morgan Stanley	15/9/2023	14.882
USD	279.047	EUR	255.000	JP Morgan	14/9/2023	2.075
USD	277.840	CNH	2.020.000	Credit Agricole	14/9/2023	43
USD	232.000	JPY	33.563.089	HSBC Bank	15/9/2023	1.801
USD	287.000	CAD	386.454	Deutsche Bank	18/9/2023	1.180
USD	280.000	NOK	2.936.229	Deutsche Bank	15/9/2023	3.844
USD	50.000	CHF	43.805	Deutsche Bank	20/9/2023	291
USD	209.000	PLN	854.824	HSBC Bank	18/9/2023	1.504
USD	71.207	AUD	110.000	Citigroup	18/9/2023	(76)
USD	988.000	MXN	16.887.129	JP Morgan	18/9/2023	(17.142)
USD	418.000	CNH	3.036.026	Goldman Sachs	18/9/2023	364
USD	43.000	ZAR	823.848	Morgan Stanley	18/9/2023	(728)
USD	280.000	MXN	4.817.397	JP Morgan	15/9/2023	(6.731)
USD	414.000	JPY	60.270.066	JP Morgan	15/9/2023	831
USD	70.000	ZAR	1.346.905	Goldman Sachs	18/9/2023	(1.468)
USD	278.000	COP	1.150.275.040	BNP Paribas	18/9/2023	(754)
USD	278.000	MXN	4.800.226	Citigroup	18/9/2023	(7.492)
USD	256.993	EUR	236.386	Goldman Sachs	20/9/2023	301
USD	240.740	GBP	189.000	Citigroup	20/9/2023	1.047
USD	273.247	COP	1.141.900.000	BNP Paribas	17/10/2023	(1.045)
USD	207.521	AUD	320.000	JP Morgan	18/9/2023	124
USD	276.000	THB	9.775.920	BNP Paribas	18/9/2023	(3.280)
USD	165.702	THB	5.871.000	BNP Paribas	14/9/2023	(1.956)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
USD	411.688	GBP	324.000	JP Morgan	18/9/2023	870
USD	406.768	AUD	634.000	Deutsche Bank	18/9/2023	(3.792)
USD	100.000	SEK	1.094.173	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(348)
USD	50.000	SEK	546.278	HSBC Bank	20/9/2023	(105)
USD	206.000	ZAR	3.859.629	Barclays	18/9/2023	778
USD	69.000	BRL	341.251	JP Morgan	5/9/2023	(233)
USD	343.000	NOK	3.664.991	Goldman Sachs	18/9/2023	(1.216)
USD	48.718	CNH	354.362	JP Morgan	20/9/2023	(27)
USD	272.000	ZAR	5.044.606	Citigroup	18/9/2023	3.554
USD	136.000	CAD	184.187	JP Morgan	18/9/2023	(162)
USD	275.000	CLP	236.775.000	Toronto-Dominion	15/9/2023	(1.616)
USD	7.078.826	MXN	119.669.681	Barclays	28/9/2023	(38.731)
USD	546.000	MXN	9.213.697	Goldman Sachs	18/9/2023	(2.958)
USD	274.000	BRL	1.339.038	Citigroup	5/9/2023	2.082
USD	218.626	BRL	1.070.000	Citigroup	14/9/2023	1.660
USD	205.000	ZAR	3.821.185	UBS	18/9/2023	1.739
USD	68.000	ZAR	1.265.175	HSBC Bank	18/9/2023	691
USD	138.000	ZAR	2.574.725	JP Morgan	18/9/2023	1.052
USD	414.000	BRL	2.023.736	HSBC Bank	5/9/2023	3.050
USD	136.589	EUR	126.000	Goldman Sachs	18/9/2023	(190)
USD	112.096	NZD	188.387	Bank of America	20/9/2023	44
USD	125.291	EUR	115.000	Morgan Stanley	18/9/2023	403
USD	410.000	CNH	2.990.416	Citigroup	18/9/2023	(1.226)
USD	84.141	EUR	77.000	Barclays	18/9/2023	501
USD	68.000	NOK	717.158	Morgan Stanley	18/9/2023	575
USD	537.870	COP	2.205.967.727	BNY Mellon	14/9/2023	2.250
ZAR	9.687.579	USD	520.860	Barclays	20/9/2023	(5.540)
ZAR	5.120.000	USD	284.230	HSBC Bank	14/9/2023	(11.041)
ZAR	9.310.000	USD	493.231	Citigroup	14/9/2023	1.667
ZAR	5.518.152	EUR	264.000	Morgan Stanley	18/9/2023	6.166
ZAR	2.662.364	USD	139.000	Morgan Stanley	18/9/2023	2.317
ZAR	17.329.335	USD	901.627	Morgan Stanley	7/11/2023	14.083
ZAR	1.313.360	USD	69.000	Barclays	18/9/2023	747
ZAR	2.543.173	USD	136.000	BNP Paribas	18/9/2023	(755)
ZAR	5.089.284	USD	272.000	Bank of America	18/9/2023	(1.366)
ZAR	7.723.629	USD	411.000	UBS	18/9/2023	(421)
ZAR	3.818.366	USD	204.000	JP Morgan	18/9/2023	(956)
Moins-value nette non réalisée						(3.293.296)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	9.446	EUR	9.859	BNY Mellon	15/9/2023	6
EUR	105	CHF	101	BNY Mellon	15/9/2023	-
Plus-value nette non réalisée						6
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
EUR	98.309	GBP	83.986	BNY Mellon	15/9/2023	227
GBP	14.092.414	EUR	16.342.492	BNY Mellon	15/9/2023	115.196
Plus-value nette non réalisée						115.423
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
EUR	132.056	JPY	20.901.318	BNY Mellon	15/9/2023	83
JPY	1.909.852.697	EUR	12.220.059	BNY Mellon	15/9/2023	(160.833)
Moins-value nette non réalisée						(160.750)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
EUR	1.084.395	SEK	12.845.900	BNY Mellon	15/9/2023	(948)
SEK	1.461.521.891	EUR	124.679.830	BNY Mellon	15/9/2023	(1.196.620)
Moins-value nette non réalisée						(1.197.568)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Catégorie d'Actions couverte en USD						
EUR	82.074	USD	89.239	BNY Mellon	15/9/2023	(135)
USD	13.942.809	EUR	12.708.095	BNY Mellon	15/9/2023	136.300
Plus-value nette non réalisée						136.165
Total des moins-values nettes non réalisées (EUR Exposition sous-jacente - EUR 859.587.156)						(4.400.020)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente EUR	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
(40)	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	4.641.200	(6.640)
(11)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	1.463.000	(6.225)
(42)	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	5.605.320	114.360
(67)	EUR	Euro Schatz	Septembre 2023	7.041.365	(3.925)
(52)	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	6.027.320	(23.687)
3	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	383.130	(3.087)
(8)	JPY	Nikkei 225 Index	Septembre 2023	823.736	(3.915)
7	JPY	TOPIX Index	Septembre 2023	1.031.216	42.379
(19)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	17.607.667	77.505
26	AUD	Australian 10 Year Bond	Septembre 2023	1.806.117	(2.939)
(16)	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	693.920	(809)
1	GBP	FTSE 100 Index	Septembre 2023	87.607	(1.133)
11	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	499.486	(12.004)
(6)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	Septembre 2023	1.721.727	(58.356)
(24)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	Septembre 2023	2.119.407	(32.780)
1	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	209.031	2.072
20	GBP	3 Month SONIA	Septembre 2023	5.544.642	(31.447)
1	KRW	Korean 10 Year Bond	Septembre 2023	76.414	(774)
28	KRW	Korean 3 Year Bond	Septembre 2023	2.022.054	(3.424)
15	USD	SGX FTSE China A50 Index	Septembre 2023	174.907	55
(4)	EUR	3 Month EURIBOR	Septembre 2023	961.900	(150)
(8)	EUR	EURO STOXX Banks Index	Septembre 2023	45.060	(3.280)
(1)	USD	3 Month SOFR	Décembre 2023	217.937	127
(95)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	10.644.259	(119.466)
(389)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	39.759.107	(296.875)
(402)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	42.975.182	(322.991)
(101)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	12.052.538	(165.313)
(22)	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	2.450.439	(19.501)
(161)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	30.223.804	(71.398)
388	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	38.195.678	145.582
89	USD	3 Month SOFR	Mars 2024	19.395.392	(73.461)
7	GBP	3 Month SONIA	Mars 2024	1.927.743	4.493
95	USD	3 Month SOFR	Juin 2024	20.744.538	(30.822)
85	USD	3 Month SOFR	Septembre 2024	18.619.661	(11.323)
3	USD	3 Month SOFR	Décembre 2024	659.688	299
(91)	USD	3 Month SOFR	Mars 2025	20.083.917	133.742
Total				318.536.109	(785.111)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 520.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(6.189)	(3.367)
CDS	USD 740.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(8.732)	(4.792)
CDS	EUR 340.000	Fund receives default protection on ENI; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(3.801)	(5.861)
CDS	EUR 112.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(1.422)	(1.392)
CDS	EUR 125.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(7.716)	(1.291)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2024	(991)	717
CDS	USD 55.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2024	(1.406)	1.315
CDS	USD 25.000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Barclays	20/6/2024	(348)	924
CDS	USD (25.000)	Fund provides default protection on Sprint Communications; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2025	(2.443)	1.802
CDS	USD (35.000)	Fund provides default protection on Sprint Communications; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2025	(3.044)	2.523
CDS	USD (11.666)	Fund provides default protection on Sprint Communications; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2025	(978)	841
CDS	EUR (43.333)	Fund provides default protection on Altice France; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2025	(3.565)	(4.497)
CDS	EUR (2.668)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2027	211	291
CDS	EUR (100.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Barclays	20/6/2027	8.814	10.901
CDS	USD 22.482	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2027	(688)	(321)
CDS	EUR (12.502)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	334	(2.858)
CDS	EUR (42.613)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	1.138	(9.740)
CDS	EUR (9.851)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	263	(2.252)
CDS	EUR (35.141)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	938	(8.032)
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2027	2.112	6.234
CDS	USD 1.146.750	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(52.684)	46.472
CDS	USD 1.087.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(40.879)	26.919
CDS	USD 98.868	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(2.037)	4.345
CDS	USD 173.234	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(2.767)	(1.051)
CDS	USD 137.716	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(1.708)	(836)
CDS	USD 541.124	Fund receives default protection on Mexican; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(9.159)	(227)
CDS	USD 55.000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2024	(848)	61
CDS	USD (102.273)	Fund provides default protection on CCO; and receives Fixed 5%	BNP Paribas	20/12/2025	(8.005)	7.269
CDS	USD 80.000	Fund receives default protection on Borgwarner; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2027	(2.156)	(1.180)
CDS	EUR 90.000	Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2027	(2.586)	3.324
CDS	EUR (150.000)	Fund provides default protection on Intesa Sanpaolo; and receives Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	762	276
CDS	EUR 450.000	Fund receives default protection on HSBC; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(766)	(4.637)
CDS	EUR 34.000	Fund receives default protection on Picard; and pays Fixed 5%	BNP Paribas	20/6/2028	(786)	(190)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(4.990)	(1.033)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(930)	1.818
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Standard Chartered; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/12/2028	(192)	(684)
CDS	EUR (25.222)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	617	(5.765)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	EUR (15.687)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	1.545	(660)
CDS	USD 1.683.694	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.39.V1; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/12/2027	(13.146)	(23.756)
CDS	USD 40.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/12/2027	3.892	12.469
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	227	6.592
CDS	USD 114.848	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2028	(1.126)	(663)
CDS	USD (280.000)	Fund provides default protection on AT&T; and receives Fixed 1%	Citibank	20/12/2023	(162)	406
CDS	EUR 182.000	Fund receives default protection on Edf; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2025	(869)	(1.485)
CDS	USD 25.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2025	(1.103)	2.497
CDS	EUR (12.365)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Citibank	20/12/2027	423	(2.826)
CDS	EUR (10.197)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Citibank	20/12/2027	349	(2.331)
CDS	USD 10.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	951	3.117
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	1.764	6.234
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	431	6.234
CDS	USD 20.000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	Citibank	20/12/2027	(539)	1.315
CDS	USD 740.000	Fund receives default protection on CVS Health; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2028	(3.229)	(13.027)
CDS	USD 100.000	Fund receives default protection on Southwest Airlines; and pays Fixed 1%	Citibank	20/6/2028	(1.068)	(169)
CDS	EUR (20.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2026	1.001	1.873
CDS	EUR (80.000)	Fund provides default protection on Intrum Justitia; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(18.455)	(12.705)
CDS	EUR (150.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	9.875	16.352
CDS	EUR (14.715)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	1.141	1.604
CDS	EUR (71.429)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	10.560	7.787
CDS	EUR (107.143)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	15.823	11.680
CDS	USD 700.000	Fund receives default protection on Caterpillar; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2027	(5.166)	(17.020)
CDS	USD 270.270	Fund receives default protection on AT&T; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(2.914)	(291)
CDS	USD 337.838	Fund receives default protection on AT&T; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(2.896)	(364)
CDS	USD 191.892	Fund receives default protection on AT&T; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(944)	(207)
CDS	USD 98.868	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.501)	4.345
CDS	USD 98.868	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.759)	4.345
CDS	USD 98.867	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.694)	4.345
CDS	USD 98.868	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.704)	4.345
CDS	USD 98.867	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.538)	4.345
CDS	USD 98.867	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.426)	4.345
CDS	USD 98.867	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.083)	4.345
CDS	USD 98.867	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.031)	4.345
CDS	USD 98.867	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(785)	4.345

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 98.867	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(908)	4.345
CDS	USD 98.867	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(887)	4.345
CDS	USD 98.868	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(839)	4.345
CDS	USD 73.557	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(485)	3.233
CDS	USD 57.424	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(584)	(331)
CDS	USD 57.425	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(585)	(331)
CDS	EUR 25.000	Fund receives default protection on Verisure Midholding; and pays Fixed 5%	Deutsche Bank	20/6/2028	(16)	(3)
CDS	USD 148.300	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Deutsche Bank	20/6/2028	(1.188)	6.517
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2024	(20)	1.109
CDS	USD 50.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(4.774)	4.994
CDS	USD 100.000	Fund receives default protection on Southwest Airlines; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2025	(2.681)	(772)
CDS	EUR (10.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2026	163	936
CDS	EUR (71.428)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2027	10.294	7.787
CDS	EUR (35.567)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	3.236	(1.496)
CDS	EUR (27.000)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	2.220	(1.136)
CDS	USD 175.000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	(3.627)	(1.181)
CDS	EUR 90.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	(2.816)	3.014
CDS	EUR 84.000	Fund receives default protection on BNP Paribas; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(2.464)	500
CDS	USD 850.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(7.543)	34.447
CDS	USD 740.000	Fund receives default protection on Comcast; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(4.151)	(14.541)
CDS	EUR 105.000	Fund receives default protection on HSBC; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(435)	887
CDS	EUR 70.000	Fund receives default protection on HSBC; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(195)	591
CDS	EUR 10.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	33	1.972
CDS	USD 143.454	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(1.709)	(870)
CDS	USD 57.381	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(736)	(348)
CDS	EUR 30.000	Fund receives default protection on Novafives; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	130	1.048
CDS	USD 143.560	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(1.667)	(828)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Intesa Sanpaolo; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2028	(541)	3.267
CDS	USD (108.333)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.A; and receives Fixed 2%	Goldman Sachs	17/9/2058	(7.166)	(8.874)
CDS	USD (102.375)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.A; and receives Fixed 2%	Goldman Sachs	17/9/2058	(6.770)	(8.386)
CDS	USD (108.333)	Fund provides default protection on CMBX.NA.A.9; and receives Fixed 2%	Goldman Sachs	17/9/2058	(7.349)	(8.874)
CDS	USD (65.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.BBB-14; and receives Fixed 3%	Goldman Sachs	16/12/2072	(4.610)	(14.681)
CDS	USD 10.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/12/2027	1.050	3.117
CDS	EUR 275.000	Fund receives default protection on ING; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(3.057)	2.304
CDS	USD 197.735	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(4.001)	8.690
CDS	USD 57.381	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(732)	(348)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 57.381	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(732)	(348)
CDS	USD 114.848	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(1.252)	(663)
CDS	EUR 26.000	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	HSBC Bank	20/6/2028	108	36
CDS	EUR (16.000)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2024	(193)	(2.124)
CDS	EUR (90.000)	Fund provides default protection on Altice France; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2025	(144)	(6.494)
CDS	EUR (80.000)	Fund provides default protection on Virgin Media Finance; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2025	(5.957)	4.153
CDS	EUR (86.667)	Fund provides default protection on Altice France; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(6.997)	(8.995)
CDS	USD (50.000)	Fund provides default protection on CCO; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(4.331)	3.554
CDS	USD (61.363)	Fund provides default protection on CCO; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(4.968)	4.361
CDS	EUR (14.786)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2027	1.107	1.612
CDS	EUR (13.899)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2027	1.040	1.515
CDS	EUR (3.932)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2027	295	429
CDS	EUR (25.877)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	569	(5.915)
CDS	EUR (21.339)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	469	(4.878)
CDS	EUR (49.313)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	5.350	(2.074)
CDS	USD 45.000	Fund receives default protection on Pitney Bowes; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	1.526	14.027
CDS	USD 80.000	Fund receives default protection on Simon Property; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	(1.647)	(540)
CDS	EUR 79.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	(1.942)	2.646
CDS	USD 40.000	Fund receives default protection on Xerox; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2027	(1.097)	2.631
CDS	EUR (61.000)	Fund provides default protection on Loxam; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	5.683	(1.824)
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Aegon; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(289)	(1.516)
CDS	EUR 44.000	Fund receives default protection on Altice France; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	1.936	8.490
CDS	EUR 42.000	Fund receives default protection on Altice France; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	1.848	8.104
CDS	EUR 90.000	Fund receives default protection on Altice France; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(490)	17.367
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Barclays; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	109	3.065
CDS	EUR 75.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(6.304)	5.054
CDS	EUR 300.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(15.152)	7.100
CDS	EUR 175.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(4.168)	4.141
CDS	EUR 59.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(1.405)	1.396
CDS	EUR 66.000	Fund receives default protection on Deutsche Bank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(1.765)	1.562
CDS	EUR 138.000	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(900)	189
CDS	EUR 30.500	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(88)	42
CDS	EUR 30.500	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(200)	42
CDS	EUR 30.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(361)	5.915

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD 98.868	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(2.059)	4.345
CDS	USD 98.868	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(2.022)	4.345
CDS	USD 98.868	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(1.992)	4.345
CDS	USD 49.434	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(904)	2.173
CDS	USD 49.434	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(581)	2.173
CDS	USD 29.660	Fund receives default protection on Lincoln National; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(276)	1.303
CDS	EUR 200.000	Fund receives default protection on Lloyds Banking; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	409	3.862
CDS	USD 57.381	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(916)	(348)
CDS	USD 85.000	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	297	3.649
CDS	USD 115.000	Fund receives default protection on Paramount Global; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	401	4.937
CDS	USD 143.561	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(1.972)	(828)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(6.073)	(1.033)
CDS	EUR 62.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(3.694)	(640)
CDS	EUR 63.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(3.631)	(651)
CDS	EUR 600.000	Fund receives default protection on UBS; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(25.162)	(6.197)
CDS	EUR 100.000	Fund receives default protection on Unicredit; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(4.739)	4.267
CDS	EUR (30.000)	Fund provides default protection on Virgin Media Finance; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(1.601)	1.610
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Commerzbank; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(2.640)	8.526
CDS	USD 86.072	Fund receives default protection on Metlife; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(1.198)	(522)
CDS	EUR 500.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2028	(4.936)	(6.216)
CDS	USD 30.000	Fund receives default protection on Staples; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2023	165	266
CDS	USD 22.482	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(688)	(321)
CDS	USD 30.036	Fund receives default protection on General Electric; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(888)	(429)
CDS	EUR 89.362	Fund receives default protection on Naturgy Energy; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(1.391)	(1.516)
CDS	EUR 55.319	Fund receives default protection on Naturgy Energy; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2027	(862)	(938)
CDS	EUR (18.762)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	412	(4.289)
CDS	EUR (15.472)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	340	(3.537)
CDS	USD 428.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(4.960)	17.345
CDS	EUR 20.000	Fund receives default protection on Novafives; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	433	698
CDS	EUR 150.000	Fund receives default protection on Solvay; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(1.097)	(1.865)
CDS	USD (216.667)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.A; and receives Fixed 2%	Morgan Stanley	17/9/2058	(14.736)	(17.749)
CDS	USD (41.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.BBB; and receives Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	(1.797)	(8.022)
CDS	USD 65.000	Fund receives default protection on Ford Motor; and pays Fixed 5%	Morgan Stanley	20/6/2028	(2.596)	(5.468)
CDS	USD (61.364)	Fund provides default protection on CCO; and receives Fixed 5%	BNP Paribas	20/12/2025	(4.810)	4.361
CDS	USD 138.334	Fund receives default protection on Prudential Financial; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(1.347)	(798)
CDS	USD 490.000	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.35; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/12/2025	(3.938)	(18.844)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
CDS	USD (3.616.768)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	44.354	98.635
CDS	USD 15.437.198	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.40; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(51.397)	(224.703)
CDS	EUR 1.190.000	Fund receives default protection on ITRAXX.EUR.39.V1; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(4.926)	(15.611)
CDS	EUR (225.274)	Fund provides default protection on ITRAXX.XO.38.V1; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	3.950	11.079
CDS	USD 572.414	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.39.V1; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	(11.407)	(17.499)
CDS	EUR 1.709.000	Fund receives default protection on ITRAXX.FINSR.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(35.347)	(14.868)
CDS	EUR 825.235	Fund receives default protection on ITRAXX.FINSUB.39.V1; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(34.808)	16.568
CDS	EUR 3.082.650	Fund receives default protection on ITRAXX.XO.39.V1; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	(39.347)	(127.320)
IFS	EUR 230.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,435%	BNP Paribas	15/5/2033	2.250	2.319
IFS	EUR 545.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,56%	Bank of America	15/6/2028	462	463
IFS	EUR 355.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,46%	Bank of America	15/7/2028	1.399	1.399
IFS	EUR 455.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,555%	Bank of America	15/6/2033	(343)	(343)
IFS	EUR 450.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,505%	Bank of America	15/7/2033	(1.757)	(1.757)
IFS	EUR 126.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,5737%	Bank of America	15/5/2038	(569)	(569)
IFS	EUR 235.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,60125%	Bank of America	15/5/2043	(2.479)	(2.326)
IFS	EUR 420.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,693%	Goldman Sachs	15/8/2032	(8.854)	(8.854)
IRS	BRL 10.624.000	Fund receives Fixed 9,98%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2026	(4.926)	(4.926)
IRS	BRL 689.162	Fund receives Fixed 11,5625%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	3.393	3.393
IRS	BRL 1.107.452	Fund receives Fixed 11,82%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	6.799	6.799
IRS	BRL 8.515.000	Fund receives Fixed 10,3164%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	4/1/2027	3.734	3.734
IRS	USD 4.648.140	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2%	BNP Paribas	17/2/2025	187.116	187.116
IRS	GBP 2.300.000	Fund receives Fixed 5,4%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	BNP Paribas	23/8/2025	3.480	3.396
IRS	BRL 1.315.492	Fund receives Fixed 11,27%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	2/1/2026	4.908	4.908
IRS	BRL 3.816.683	Fund receives Fixed 10,0325%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(6.262)	(6.262)
IRS	BRL 28.971	Fund receives Fixed 10,12%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(33)	(33)
IRS	BRL 5.190.745	Fund receives Fixed 10,1225%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(5.892)	(5.892)
IRS	BRL 120.000	Fund receives Fixed 9,94%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(235)	(235)
IRS	EUR 530.000	Fund receives Fixed 2,78%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	1/8/2033	(465)	(240)
IRS	MXN 1.808.000	Fund receives Fixed 8,58%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	BNP Paribas	1/8/2033	(1.242)	(1.242)
IRS	EUR 270.000	Fund receives Fixed 3%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	17/8/2033	2.402	2.235
IRS	USD 55.093.779	Fund receives Fixed 4,4005%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	13/2/2024	(269.832)	(269.832)
IRS	USD 27.546.890	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,7505%	Bank of America	13/2/2024	206.866	206.866
IRS	MXN 30.414.742	Fund receives Fixed 4,68%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	27/2/2024	(54.900)	(54.900)
IRS	MXN 30.316.629	Fund receives Fixed 4,855%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	1/3/2024	(54.138)	(54.138)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IRS	USD 5.184.641	Fund receives Fixed 1,1285%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	7/3/2024	(106.143)	(106.143)
IRS	USD 40.577.070	Fund receives Fixed 1,12925%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	8/3/2024	(834.844)	(834.844)
IRS	USD 3.526.600	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,61%	Bank of America	8/3/2024	31.765	32.340
IRS	USD 27.044.000	Fund receives Fixed 4,505%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	9/3/2024	(138.856)	(138.856)
IRS	USD 33.837.275	Fund receives Fixed 1,079%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	18/3/2024	(740.263)	(740.263)
IRS	USD 1.908.200	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,61%	Bank of America	19/3/2024	18.289	18.443
IRS	GBP 37.687.528	Fund receives Fixed 3,22%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	3/4/2024	(631.541)	(631.541)
IRS	GBP 18.843.264	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 2,47%	Bank of America	3/4/2024	408.122	408.122
IRS	EUR 39.929.513	Fund receives Fixed 1,75%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	4/5/2024	(578.590)	(578.590)
IRS	EUR 19.965.256	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 1%	Bank of America	4/5/2024	387.358	387.358
IRS	USD 8.001.100	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	28/6/2024	111.418	112.680
IRS	KRW 2.547.620.000	Fund receives Fixed 3,865%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	3/7/2024	853	853
IRS	USD 28.760.000	Fund receives Fixed 4,4605%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	12/7/2024	(220.995)	(220.995)
IRS	USD 14.155.950	Fund receives Fixed 5,3715%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	12/7/2024	(9.994)	(9.994)
IRS	USD 14.155.950	Fund receives Fixed 5,3745%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	12/7/2024	(9.668)	(9.668)
IRS	USD 7.327.600	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,55%	Bank of America	13/7/2024	106.967	108.263
IRS	USD 15.667.000	Fund receives Fixed 3,123%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	16/7/2024	(283.737)	(283.737)
IRS	USD 11.022.100	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,57%	Bank of America	16/7/2024	161.524	161.379
IRS	USD 10.965.300	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	20/7/2024	163.165	163.780
IRS	USD 14.411.300	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	23/7/2024	214.814	215.557
IRS	USD 10.559.600	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	12/8/2024	165.782	164.826
IRS	USD 6.854.600	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,56%	Bank of America	13/8/2024	107.926	107.235
IRS	USD 19.537.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,53%	Bank of America	27/8/2024	315.767	319.158
IRS	GBP 7.522.257	Fund receives Fixed 4,255%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	6/9/2024	(124.710)	(124.710)
IRS	COP 3.527.030.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 11,895%	Bank of America	19/10/2024	(2.456)	(2.456)
IRS	USD 29.504.412	Fund receives Fixed 4,592%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	14/12/2024	(130.701)	(130.725)
IRS	NZD 2.580.000	Fund receives Fixed 4,697%; and pays Floating NZD BBR 3 Month	Bank of America	20/12/2024	(11.806)	(11.806)
IRS	AUD 2.235.000	Fund receives Floating AUD BBSW 3 Month; and pays Fixed 4,0425%	Bank of America	20/12/2024	2.448	2.448
IRS	BRL 5.266.650	Fund receives Fixed 11,865%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	11.707	11.707
IRS	BRL 407.661	Fund receives Fixed 13,125%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	2.410	2.410
IRS	BRL 8.489.371	Fund receives Fixed 13,15%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	50.917	50.917
IRS	BRL 8.470.928	Fund receives Fixed 13,32%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	55.807	55.807
IRS	JPY 50.580.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,23%	Bank of America	11/1/2025	(764)	(764)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IRS	JPY 396.100.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,235%	Bank of America	19/1/2025	(6.179)	(6.179)
IRS	MXN 15.010.297	Fund receives Fixed 9,8%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	4/2/2025	(8.237)	(8.237)
IRS	MXN 56.394.688	Fund receives Fixed 9,9%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	5/2/2025	(26.727)	(26.727)
IRS	MXN 27.172.839	Fund receives Fixed 9,92%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	5/2/2025	(12.477)	(12.477)
IRS	MXN 62.529.000	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	7/2/2025	(27.150)	(27.150)
IRS	AUD 2.150.000	Fund receives Floating AUD BBSW 3 Month; and pays Fixed 3,8025%	Bank of America	9/2/2025	7.212	7.212
IRS	NZD 2.390.000	Fund receives Fixed 4,94%; and pays Floating NZD BBR 3 Month	Bank of America	10/2/2025	(11.151)	(11.151)
IRS	USD 16.522.808	Fund receives Fixed 2,601%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	17/2/2025	(537.675)	(537.675)
IRS	USD 16.522.808	Fund receives Fixed 2,701%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	17/2/2025	(516.466)	(516.466)
IRS	USD 27.333.743	Fund receives Fixed 4,031%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	10/3/2025	(391.716)	(391.716)
IRS	ZAR 39.903.000	Fund receives Fixed 7,2%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Bank of America	20/3/2025	(11.853)	(11.853)
IRS	CZK 88.400.000	Fund receives Floating CZK-PRIBOR-PRBO 3 Month; and pays Fixed 4,615%	Bank of America	19/6/2025	(14.129)	(14.129)
IRS	USD 3.829.440	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 4,7915%	Bank of America	4/8/2025	3.636	3.636
IRS	GBP 7.140.000	Fund receives Fixed 5,28523%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	7/8/2025	2.799	(459)
IRS	GBP 7.130.000	Fund receives Fixed 5,34%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	7/8/2025	3.467	3.654
IRS	EUR 15.970.000	Fund receives Floating EUR ESTR 1 Day; and pays Fixed 3,12083%	Bank of America	9/8/2025	(874)	(4.334)
IRS	USD 15.403.371	Fund receives Fixed 4,104%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	11/8/2025	(191.148)	(191.148)
IRS	USD 874.000	Fund receives Fixed 4,053%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	16/8/2025	(11.566)	(11.566)
IRS	GBP 760.000	Fund receives Fixed 5,795%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/8/2025	4.468	4.468
IRS	USD 420.000	Fund receives Fixed 4,1115%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	24/8/2025	(5.117)	(5.117)
IRS	USD 437.000	Fund receives Fixed 4,1527%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	24/8/2025	(5.013)	(5.013)
IRS	USD 420.000	Fund receives Fixed 4,1005%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	25/8/2025	(5.194)	(5.194)
IRS	USD 437.000	Fund receives Fixed 4,1327%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	25/8/2025	(5.162)	(5.162)
IRS	USD 840.000	Fund receives Fixed 4,181%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/8/2025	(9.198)	(9.198)
IRS	JPY 339.000.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,1045%	Bank of America	20/9/2025	1.771	1.772
IRS	USD 28.784.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,891%	Bank of America	5/12/2025	446.370	446.370
IRS	USD 3.810.000	Fund receives Fixed 3,8085%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	19/12/2025	(65.020)	(65.020)
IRS	GBP 630.000	Fund receives Fixed 3,6%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/3/2026	(7.667)	(7.697)
IRS	GBP 330.000	Fund receives Fixed 3,75343%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/3/2026	(4.242)	(3.513)
IRS	GBP 3.170.000	Fund receives Fixed 3,568%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	31/3/2026	(39.161)	(39.161)
IRS	GBP 320.000	Fund receives Fixed 3,7%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	31/3/2026	(3.521)	(3.521)
IRS	GBP 12.540.000	Fund receives Fixed 3,46%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	7/4/2026	(167.931)	(167.554)
IRS	USD 7.396.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,15%	Bank of America	27/5/2026	227.375	234.398

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IRS	JPY 449.130.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,266%	Bank of America	7/7/2026	4.813	4.813
IRS	JPY 101.330.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,2925%	Bank of America	7/7/2026	918	918
IRS	JPY 101.310.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,3205%	Bank of America	7/7/2026	740	740
IRS	JPY 101.330.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,324%	Bank of America	7/7/2026	718	718
IRS	JPY 303.930.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,33%	Bank of America	7/7/2026	2.038	2.038
IRS	JPY 155.024.700	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,331%	Bank of America	7/7/2026	1.030	1.030
IRS	JPY 148.945.300	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,364%	Bank of America	7/7/2026	682	682
IRS	KRW 1.974.725.950	Fund receives Fixed 3,1875%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(17.999)	(17.999)
IRS	KRW 1.459.580.050	Fund receives Fixed 3,19%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(13.232)	(13.232)
IRS	KRW 769.383.054	Fund receives Fixed 3,33%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(4.852)	(4.852)
IRS	KRW 873.374.498	Fund receives Fixed 3,376%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(4.716)	(4.716)
IRS	KRW 769.498.473	Fund receives Fixed 3,38%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(4.095)	(4.095)
IRS	KRW 769.498.473	Fund receives Fixed 3,3825%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(4.057)	(4.057)
IRS	KRW 873.374.497	Fund receives Fixed 3,384%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(4.579)	(4.579)
IRS	KRW 873.243.498	Fund receives Fixed 3,389%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(4.492)	(4.492)
IRS	BRL 2.568.000	Fund receives Fixed 10,04%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(4.549)	(4.549)
IRS	BRL 240.000	Fund receives Fixed 10,11%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(261)	(261)
IRS	BRL 5.410.121	Fund receives Fixed 10,12%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(6.220)	(6.220)
IRS	BRL 4.272.857	Fund receives Fixed 9,965%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(7.174)	(7.174)
IRS	BRL 1.150.000	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 10,1%	Bank of America	4/1/2027	778	778
IRS	USD 1.383.820	Fund receives Fixed 1,549%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	7/3/2027	(112.665)	(112.665)
IRS	USD 2.969.000	Fund receives Fixed 3,468%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	10/3/2027	(8.072)	(8.072)
IRS	GBP 1.520.000	Fund receives Fixed 3,44723%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	16/3/2027	(16.024)	(14.026)
IRS	MXN 27.000.000	Fund receives Fixed 5,335%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	21/9/2027	(189.410)	(189.410)
IRS	USD 7.876.758	Fund receives Fixed 2,9095%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	6/10/2027	(342.182)	(342.182)
IRS	MXN 8.262.000	Fund receives Fixed 5,275%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	2/11/2027	(59.873)	(59.873)
IRS	MXN 16.758.000	Fund receives Fixed 8,42%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	20/1/2028	(20.221)	(20.221)
IRS	GBP 1.560.000	Fund receives Fixed 3,2%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/1/2028	(13.907)	(13.472)
IRS	GBP 10.351.200	Fund receives Fixed 3,18%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	10/2/2028	(90.176)	(90.176)
IRS	MXN 9.542.000	Fund receives Fixed 8,35%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	28/4/2028	(12.443)	(12.443)
IRS	GBP 760.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 4,638%	Bank of America	26/5/2028	7.427	7.427
IRS	EUR 943.000	Fund receives Fixed 3,1518%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	21/7/2028	(310)	(309)
IRS	GBP 170.000	Fund receives Fixed 4,86823%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	4/8/2028	371	518

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IRS	GBP 160.000	Fund receives Fixed 4,8733%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	4/8/2028	528	528
IRS	GBP 160.000	Fund receives Fixed 4,77918%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	11/8/2028	518	(196)
IRS	GBP 170.000	Fund receives Fixed 4,9008%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	11/8/2028	825	825
IRS	MXN 30.653.000	Fund receives Fixed 9,1343%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	15/8/2028	14.240	14.240
IRS	CZK 21.298.000	Fund receives Fixed 4,321%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	3.515	3.515
IRS	PLN 2.643.000	Fund receives Floating PLN WIBOR 6 Month; and pays Fixed 5,7005%	Bank of America	20/9/2028	(30.910)	(30.910)
IRS	USD 6.760.600	Fund receives Fixed 2,85%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	14/10/2031	(387.617)	(436.712)
IRS	USD 7.700.600	Fund receives Fixed 2,86%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	19/11/2031	(447.050)	(496.625)
IRS	USD 13.194.500	Fund receives Fixed 2,85%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/1/2032	(777.054)	(872.784)
IRS	USD 1.057.383	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,3525%	Bank of America	8/4/2032	105.987	105.987
IRS	USD 7.167.463	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,58%	Bank of America	24/5/2032	614.370	615.712
IRS	EUR 823.004	Fund receives Fixed 2,4425%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	14/7/2032	(14.449)	(14.449)
IRS	USD 4.093.581	Fund receives Fixed 3,04%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/10/2032	(231.120)	(231.120)
IRS	USD 3.397.474	Fund receives Fixed 2,868%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	2/11/2032	(233.098)	(233.098)
IRS	USD 3.429.730	Fund receives Fixed 2,908%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	4/11/2032	(225.779)	(225.779)
IRS	USD 5.626.573	Fund receives Fixed 2,8905%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	15/11/2032	(378.191)	(378.191)
IRS	USD 3.711.580	Fund receives Fixed 3,191%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/11/2032	(171.262)	(171.262)
IRS	AUD 500.000	Fund receives Fixed 4,15%; and pays Floating AUD BBSW 6 Month	Bank of America	9/2/2033	(5.169)	(5.169)
IRS	NZD 550.000	Fund receives Floating NZD BBR 3 Month; and pays Fixed 4,2525%	Bank of America	10/2/2033	10.467	10.467
IRS	EUR 590.000	Fund receives Fixed 2,962%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	31/3/2033	(4.311)	(4.240)
IRS	CHF 380.000	Fund receives Floating CHF SARON 1 Day; and pays Fixed 1,912%	Bank of America	31/3/2033	(7.061)	(6.713)
IRS	GBP 120.000	Fund receives Fixed 3,4329%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/6/2033	(1.642)	(1.642)
IRS	GBP 160.000	Fund receives Fixed 3,6589%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/6/2033	(676)	(676)
IRS	MXN 3.646.000	Fund receives Fixed 8,5%; and pays Floating MXN MXIBTIIE 1 Month	Bank of America	28/7/2033	(3.569)	(3.569)
IRS	USD 3.736.279	Fund receives Fixed 3,7565%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	9/8/2033	(20.530)	(20.530)
IRS	USD 1.827.903	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,23%	Bank of America	9/8/2033	82.461	82.461
IRS	EUR 310.000	Fund receives Fixed 2,85708%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	28/8/2033	795	732
IRS	USD 596.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,93%	Bank of America	26/11/2041	61.598	60.460
IRS	EUR 40.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,668%	Bank of America	4/2/2048	1.288	1.288
IRS	EUR 320.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,8133%	Bank of America	15/8/2048	1.507	1.507
IRS	USD 1.471.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,81%	Bank of America	28/1/2051	202.839	180.500
IRS	USD 2.058.400	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	1/2/2051	283.026	255.725
IRS	USD 1.164.900	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	4/2/2051	160.239	144.717
IRS	USD 1.194.900	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	5/2/2051	164.365	148.443

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IRS	USD 1.815.700	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	27/5/2051	323.719	225.144
IRS	USD 301.900	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	28/5/2051	53.825	37.435
IRS	USD 571.900	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8%	Bank of America	7/6/2051	102.006	70.903
IRS	USD 2.767.500	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,79%	Bank of America	21/1/2052	499.857	346.580
IRS	JPY 1.328.710	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,88%	Bank of America	23/5/2052	1.072	1.072
IRS	JPY 1.094.847	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,85%	Bank of America	26/5/2052	934	934
IRS	JPY 1.096.153	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,7915%	Bank of America	27/5/2052	1.033	1.033
IRS	JPY 3.513.900	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,99%	Bank of America	26/7/2052	2.261	2.261
IRS	EUR 20.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,761%	Bank of America	4/10/2052	(80)	(80)
IRS	EUR 70.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,2705%	Bank of America	4/3/2053	6.375	6.375
IRS	CHF 150.000	Fund receives Fixed 1,8565%; and pays Floating CHF SARON 1 Day	Bank of America	31/3/2053	5.234	4.871
IRS	EUR 170.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,508%	Bank of America	31/3/2053	7.397	7.343
IRS	BRL 19.816.632	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(621)	(621)
IRS	BRL 26.990.538	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(846)	(846)
IRS	COP 6.801.362.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 12,37%	Citibank	18/4/2024	1.208	1.208
IRS	BRL 2.330.202	Fund receives Fixed 13,22%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2025	14.542	14.542
IRS	BRL 5.011.000	Fund receives Fixed 11,745%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	28.845	28.845
IRS	BRL 352.677	Fund receives Fixed 11,76%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	2.060	2.060
IRS	BRL 5.081.760	Fund receives Fixed 11,8%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	30.695	30.695
IRS	BRL 4.060.130	Fund receives Fixed 10,1%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(5.147)	(5.147)
IRS	BRL 4.159.312	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(7.341)	(7.341)
IRS	COP 1.793.969.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 10,2%	Goldman Sachs	28/2/2025	146	146
IRS	USD 3.556.000	Fund receives Fixed 3,75736%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	15/12/2025	(64.328)	(64.328)
IRS	BRL 11.040.000	Fund receives Fixed 10,1075%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	2/1/2026	81	81
IRS	ZAR 17.031.344	Fund receives Floating ZAR JIBAR 3 Month; and pays Fixed 8,22%	Goldman Sachs	20/9/2026	(7.032)	(7.032)
IRS	BRL 6.939.929	Fund receives Fixed 10,005%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(13.209)	(13.209)
IRS	BRL 10.846.579	Fund receives Fixed 10,05%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(16.678)	(16.678)
IRS	BRL 533.000	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 10,105%	Goldman Sachs	4/1/2027	389	389
IRS	GBP 1.985.000	Fund receives Fixed 4,86%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Goldman Sachs	20/6/2028	2.991	2.991
IRS	EUR 3.049.427	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 0,02%	Goldman Sachs	26/8/2031	648.785	648.785
IRS	USD 1.287.359	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,585%	Goldman Sachs	26/5/2032	110.218	110.218
IRS	USD 3.492.420	Fund receives Fixed 3,4665%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	4/10/2032	(92.152)	(92.152)
IRS	USD 1.613.221	Fund receives Fixed 3,415%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	5/10/2032	(48.376)	(48.376)
IRS	EUR 2.252.000	Fund receives Fixed 2,34%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Goldman Sachs	19/1/2033	(36.872)	(36.872)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
IRS	USD 4.282.636	Fund receives Fixed 3,136%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Goldman Sachs	12/5/2033	(61.267)	(61.267)
IRS	ZAR 8.698.012	Fund receives Fixed 9,895%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	16.421	16.421
IRS	ZAR 4.349.006	Fund receives Fixed 9,896%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	8.225	8.225
IRS	ZAR 4.349.006	Fund receives Fixed 9,9175%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Goldman Sachs	20/9/2033	8.527	8.527
IRS	BRL 4.429.571	Fund receives Fixed 13,18%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2025	27.027	27.027
IRS	BRL 368.218	Fund receives Fixed 11,775%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2026	2.178	2.178
IRS	BRL 4.149.734	Fund receives Fixed 10,025%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	(5.538)	(5.538)
IRS	BRL 230.000	Fund receives Fixed 10,425%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	1	1
IRS	BRL 16.743.089	Fund receives Fixed 12,7825%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2025	79.293	79.294
IRS	GBP 60.000	Fund receives Fixed 5,628%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	19/8/2025	217	227
IRS	GBP 1.560.000	Fund receives Fixed 5,65%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	22/8/2025	6.341	6.341
IRS	BRL 647.540	Fund receives Fixed 11,83%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2026	4.008	4.008
IRS	GBP 2.460.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 4,75%	Morgan Stanley	26/8/2026	(3.954)	(3.689)
IRS	BRL 4.154.200	Fund receives Fixed 9,99%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	4/1/2027	(6.379)	(6.379)
IRS	EUR 1.260.000	Fund receives Fixed 3,0313%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Morgan Stanley	23/8/2033	11.936	11.936
IRS	USD 1.480.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,8642%	Morgan Stanley	23/8/2033	(15.665)	(15.665)
IRS	EUR 850.000	Fund receives Fixed 2,87515%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Morgan Stanley	25/8/2033	2.751	2.661
IRS	USD 980.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,71334%	Morgan Stanley	25/8/2033	(5.957)	(5.264)
IRS	USD 360.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,828%	Morgan Stanley	26/8/2035	(6.626)	(6.564)
TRS	USD (426)	Fund receives USD SOFR 1 Day - 100bps; and pays Western Alliance + 0bps	Citibank	6/9/2023	942	(19.770)
TRS	USD 120	Fund receives S5INDU Performance Shell + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 38bps	Citibank	20/9/2023	2.856	2.856
TRS	USD 605.263	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	(4.345)	(4.876)
TRS	USD 6.046	Fund receives JPM EMBIG DIV CORE + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 75bps	JP Morgan	20/9/2023	(28.625)	(28.625)
TRS	USD 1.928.164	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	JP Morgan	20/9/2023	21.118	16.623
TRS	USD 950.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	(1.220)	(2.032)
TRS	USD 1.365.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	14.918	11.768
TRS	USD 400.000	Fund receives USD SOFR 1 Day + 0bps; and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps	Morgan Stanley	20/9/2023	591	1.400
TRS	USD 828.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	BNP Paribas	20/9/2023	9.556	7.541
TRS	USD 328.000	Fund receives USD SOFR 1 Day + 0bps; and pays Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps	BNP Paribas	20/9/2023	(2.910)	(2.153)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 924.715.529)					(3.910.638)	(4.097.597)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
775.000	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 145	1/9/2023	(187)	6.003
40.000	Put	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1,017	12/9/2023	(1.568)	-
645.894	Put	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7,1	22/9/2023	(5.340)	134
562.000	Put	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 4,65	27/9/2023	(1.249)	124
510.000	Put	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,4	6/10/2023	367	9.884
633.600	Call	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7,35	16/10/2023	(560)	660
379.522	Call	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0,67	9/11/2023	(460)	607
820.000	Put	OTC USD/INR	Bank of America	USD 82,6	15/11/2023	(673)	523
650.000	Put	OTC USD/INR	Bank of America	USD 82,6	15/11/2023	(785)	415
370.000	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 150	1/5/2024	644	2.611
961.026	Call	OTC USD/NOK	Barclays	USD 10,7	22/9/2023	5.281	9.494
704.000	Put	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7,1	28/9/2023	(4.968)	297
558.000	Put	OTC USD/MXN	Barclays	USD 17,2	6/10/2023	6.697	14.158
506.000	Put	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,08	16/10/2023	516	3.527
430.000	Call	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,125	20/12/2023	(2.092)	1.803
41.000	Put	OTC USD/JPY	Citibank	USD 125	7/9/2023	(6.583)	-
130.000	Put	OTC USD/CNH	Citibank	USD 7,1	25/9/2023	(1.171)	186
70.000	Put	OTC CNH/USD	Citibank	USD 7,22	26/11/2024	3.091	10.929
502.000	Call	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,105	11/9/2023	(4.540)	184
1.013.870	Put	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 4,8	19/9/2023	(4.340)	2.026
2.230.000	Call	OTC USD/HKD	Goldman Sachs	USD 7,81	8/11/2023	1.846	4.914
64.000	Put	OTC PLN/EUR	HSBC Bank	EUR 4,66	1/11/2023	6.616	14.008
3.500.000	Call	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7,82	10/11/2023	870	4.649
52.000	Put	OTC EUR/USD	HSBC Bank	EUR 1,05	16/11/2023	42	6.334
15.354.129	Call	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 8,5	21/8/2024	(16.864)	3.909
5.528.518	Put	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,099	25/9/2023	38.825	80.953
1.900.153	Call	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0,7	2/10/2023	(1.022)	73
630.000	Call	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,133	12/10/2023	(4.052)	206
1.500.000	Put	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6,9	18/10/2023	(6.357)	63
962.107	Call	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 143	31/10/2023	10.517	19.859
1.267.337	Put	OTC USD/CAD	JP Morgan	USD 1,3	8/11/2023	(1.604)	667
4.640.155	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16,6	12/9/2023	(12.430)	9.191
90.000	Put	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1,06	27/9/2023	6.864	17.619
108.400	Put	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1,06	20/10/2023	17.283	33.922
3.084.300	Call	OTC USD/HKD	Morgan Stanley	USD 7,81	13/11/2023	1.409	6.600
320.342	Put	OTC USD/NOK	UBS	USD 9,8	22/9/2023	(1.751)	24
44	Put	EURO STOXX 50 Index	Bank of America	EUR 4.000	20/10/2023	(633)	907
90	Put	EURO STOXX 50 Index	Bank of America	EUR 4.100	20/10/2023	(998)	2.791
159.000	Call	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 239,439	10/11/2023	1.314	10.822
69	Put	EURO STOXX 50 Index	BNP Paribas	EUR 4.125	17/11/2023	1.012	2.547
54	Call	S&P 500 Index	Citibank	USD 4.100	15/9/2023	(4.591)	7
37.194.986	Put	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,07	27/9/2023	(60.234)	127
233	Put	NXP Semiconductors	Goldman Sachs	EUR 715	20/10/2023	(1.435)	-
264.894	Call	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 239,3	10/11/2023	1.804	18.143
106.106	Call	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 239,43	10/11/2023	1.681	7.225
157	Call	NASDAQ 100 Index	UBS	USD 15.700	15/9/2023	(6.069)	20.030
4	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 500	1/9/2023	(1.686)	1.668
9	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 449	1/9/2023	1.195	3.347
9	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 449	1/9/2023	(1.215)	460
7	Put	Spirax-Sarco Engineering	Exchange Traded	USD 4.400	1/9/2023	(25.507)	242
15	Put	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 15	15/9/2023	(370)	173
7	Put	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 12,5	15/9/2023	(345)	129
15	Put	Ally Financial	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(501)	173
64	Put	Ally Financial	Exchange Traded	USD 20	15/9/2023	(10.227)	177
48	Call	Barclays	Exchange Traded	GBP 1,6	15/9/2023	(1.882)	140
48	Call	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(5.869)	111
2	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	10.248	12.959

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
3	Call	First Solar	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(2.209)	209
63	Call	Ford Motor	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(2.954)	58
19	Call	General Motors	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(2.652)	44
7	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 360	15/9/2023	(6.532)	165
8	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 355	15/9/2023	(8.484)	299
8	Put	NVIDIA	Exchange Traded	USD 375	15/9/2023	(3.508)	100
6	Put	RingCentral	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(171)	55
10	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 5	15/9/2023	85	272
9	Put	Seagate Technology	Exchange Traded	USD 57,5	15/9/2023	(355)	25
7	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	15/9/2023	(910)	29
53	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	(33.831)	2.125
35	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(247)	242
15	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 17	15/9/2023	(244)	104
27	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(4.763)	635
12	Call	UniCredit	Exchange Traded	EUR 23	15/9/2023	(2.226)	2.115
6	Call	United Rentals	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	1.276	13.411
14	Call	Valero Energy	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(3.630)	394
6	Put	Viasat	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(324)	97
3	Put	Viasat	Exchange Traded	USD 22,5	15/9/2023	(57)	28
8	Call	Vinci	Exchange Traded	EUR 110	15/9/2023	(1.576)	64
15	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 25	20/9/2023	(753)	187
62	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 445	22/9/2023	(2.457)	15.744
4	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 108,5	22/9/2023	(904)	374
2	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 461	29/9/2023	(964)	411
35	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 94,875	13/10/2023	19.160	26.413
53	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95	13/10/2023	40.912	54.346
88	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,625	13/10/2023	129.515	213.928
10	Put	Ally Financial	Exchange Traded	USD 23	20/10/2023	(237)	253
11	Call	Apple	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	7.887	11.812
5	Call	Apple	Exchange Traded	USD 185	20/10/2023	2.311	3.698
31	Call	Micron Technology	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	6.646	11.858
40	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 435	20/10/2023	(14.536)	11.411
62	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 463	20/10/2023	2.454	21.572
15	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	20/10/2023	(207)	207
16	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/11/2023	382	6.304
1	Call	Broadcom	Exchange Traded	USD 900	17/11/2023	2.104	5.871
94	Call	Kenvue	Exchange Traded	USD 25	17/11/2023	(1.712)	4.982
6	Call	Lennar	Exchange Traded	USD 135	17/11/2023	(2.648)	816
15	Call	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 140	17/11/2023	497	6.809
23	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 94	15/12/2023	(1.021)	596
30	Put	Ford Motor	Exchange Traded	USD 10	15/12/2023	51	512
10	Put	Stellantis	Exchange Traded	USD 14	15/12/2023	(130)	138
10	Put	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 500	15/12/2023	(1.340)	1.650
10	Put	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 600	15/12/2023	(2.265)	8.700
25	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 6	19/1/2024	797	1.290
15	Call	Sabre	Exchange Traded	USD 7	19/1/2024	204	518
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 50.501.952)						28.398	779.605

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
(775.000)	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 145	1/9/2023	(3.247)	(6.003)
(775.073)	Put	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6,95	22/9/2023	2.063	(1)
(510.000)	Call	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,7	6/10/2023	3.566	(1.288)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
(510.000)	Put	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,2	6/10/2023	561	(2.322)
(960.000)	Put	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7,27	6/10/2023	459	(6.063)
(320.342)	Put	OTC USD/NOK	Barclays	USD 9,8	22/9/2023	3.065	(24)
(704.000)	Call	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7,25	28/9/2023	(2.163)	(4.259)
(704.000)	Put	OTC USD/CNH	Barclays	USD 6,95	28/9/2023	1.406	(6)
(420.000)	Call	OTC USD/MXN	Barclays	USD 18,3	6/10/2023	2.473	(215)
(558.000)	Put	OTC USD/MXN	Barclays	USD 16,7	6/10/2023	(1.838)	(4.210)
(506.000)	Call	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,115	16/10/2023	1.062	(926)
(752.000)	Call	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,12	11/9/2023	3.207	(13)
(3.530.000)	Put	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,06	27/9/2023	4.009	(3.934)
(253.467)	Call	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 5,05	19/9/2023	1.798	(946)
(1.901.006)	Put	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 4,68	19/9/2023	3.315	(468)
(3.500.000)	Call	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7,85	10/11/2023	274	(530)
(374.784)	Call	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146,5	11/9/2023	534	(1.541)
(374.784)	Put	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146,5	11/9/2023	(712)	(2.787)
(5.528.518)	Put	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,079	25/9/2023	(8.858)	(25.112)
(1.500.000)	Put	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6,775	18/10/2023	2.536	(3)
(1.611.894)	Call	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146,5	31/10/2023	(7.780)	(14.650)
(317.584)	Call	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 143	31/10/2023	(2.142)	(6.555)
(430.000)	Call	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,125	20/12/2023	4.629	(1.803)
(4.640.155)	Put	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16,2	12/9/2023	5.844	(178)
(1.548.600)	Call	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,11	20/10/2023	1.013	(2.898)
(961.026)	Call	OTC USD/NOK	UBS	USD 10,7	22/9/2023	(4.123)	(9.494)
(159.000)	Call	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 262,243	10/11/2023	1.189	(3.358)
(37.194.986)	Call	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,57	27/9/2023	17.717	-
(37.194.986)	Call	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,68	27/9/2023	26.003	(8.489)
(264.894)	Call	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 262,09	10/11/2023	1.975	(5.643)
(106.106)	Call	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 262,232	10/11/2023	(9)	(2.242)
(8)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.300	1/9/2023	12.251	(111)
(48)	Call	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	1.438	(44)
(3)	Put	First Solar	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	(1.364)	(2.226)
(63)	Put	Ford Motor	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(3.825)	(5.139)
(19)	Put	General Motors	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	(1.487)	(2.995)
(12)	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 380	15/9/2023	5.244	(61)
(7)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 320	15/9/2023	1.779	(1.407)
(53)	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	13.867	(611)
(27)	Put	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 42,5	15/9/2023	2.571	(336)
(12)	Put	UniCredit	Exchange Traded	EUR 20	15/9/2023	2.138	(237)
(8)	Put	Vinci	Exchange Traded	EUR 100	15/9/2023	617	(328)
(15)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 40	20/9/2023	231	(55)
(33)	Put	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 106,5	22/9/2023	11.403	(11.644)
(35)	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 95,125	13/10/2023	(31.266)	(45.567)
(53)	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,25	13/10/2023	(59.201)	(83.656)
(88)	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,375	13/10/2023	(109.775)	(163.741)
(16)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	2.183	(641)
(31)	Put	Micron Technology	Exchange Traded	USD 52,5	20/10/2023	1.949	(586)
(2)	Put	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.250	20/10/2023	1.951	(3.263)
(6)	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 109	27/10/2023	3.248	(2.765)
(16)	Put	Amazon.com	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	1.011	(2.205)
(1)	Put	Broadcom	Exchange Traded	USD 760	17/11/2023	1.091	(857)
(94)	Put	Kenvue	Exchange Traded	USD 20	17/11/2023	414	(1.516)
(6)	Put	Lennar	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(1.035)	(2.461)
(15)	Put	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(420)	(1.804)
(31)	Put	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 105,5	24/11/2023	5.707	(13.617)
(10)	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/12/2023	(13.937)	(38.278)
(20)	Put	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 550	15/12/2023	3.920	(7.250)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 43.220.229)						(91.471)	(509.362)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
USD 15.463.738	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 8/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 8/9/2024	Morgan Stanley	6/9/2023	(104.498)	22.308
USD 7.803.464	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,65% Fixed semi-annually from 14/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/9/2024	Citibank	12/9/2023	(46.014)	1.036
USD 2.346.146	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 15/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/9/2024	Citibank	13/9/2023	(16.072)	235
USD 400.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(811)	622
USD 400.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	BNP Paribas	20/9/2023	(1.147)	298
USD 400.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	(1.781)	225
USD 400.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Barclays	20/9/2023	(1.067)	420
EUR 8.890.000	Fund purchases a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.EUR.39.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 1% Fixed	Morgan Stanley	20/9/2023	(9.051)	5.506
USD 2.216.171	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,81% Fixed semi-annually from 25/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 25/9/2024	Morgan Stanley	21/9/2023	(38.394)	2
USD 949.414	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,8% Fixed semi-annually from 26/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/9/2024	Morgan Stanley	22/9/2023	(21.811)	1
USD 4.222.056	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,75% Fixed annually from 23/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 23/10/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	(16.194)	690
USD 3.265.742	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,05% Fixed semi-annually from 26/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/10/2024	Citibank	24/10/2023	(59.735)	1.652
USD 3.265.742	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 26/10/2024; and pays 4,55% Fixed semi-annually from 26/4/2024	Citibank	24/10/2023	(81.036)	3.326
USD 3.265.742	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,9% Fixed semi-annually from 1/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 1/11/2024	JP Morgan	30/10/2023	(58.927)	1.100
USD 3.265.742	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 1/11/2024; and pays 4,4% Fixed semi-annually from 1/5/2024	JP Morgan	30/10/2023	(60.953)	6.774
USD 1.555.733	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/11/2024; and pays 3,65% Fixed semi-annually from 3/5/2024	Citibank	1/11/2023	7.955	26.601
USD 1.308.046	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 9/11/2024; and pays 4,82% Fixed semi-annually from 9/5/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(19.234)	902
USD 1.308.046	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,82% Fixed semi-annually from 9/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/11/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(14.373)	446
USD 1.023.750	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	(39.257)	1.649
JPY 95.545.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	4.247	9.197
JPY 59.237.900	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	2.625	5.702
JPY 36.307.100	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	1.617	3.495
USD 16.822.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,5% Fixed semi-annually from 24/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 24/1/2025	Citibank	22/11/2024	(18.492)	19.105

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
USD 16.822.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,55% Fixed semi-annually from 26/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/1/2025	Citibank	24/1/2024	(15.059)	21.434
USD 62.168.821	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,45% Fixed semi-annually from 14/8/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/2/2025	Citibank	12/2/2024	(48.426)	87.991
EUR 8.950.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/10/2024; and pays 3,37% Fixed annually from 29/7/2025	Citibank	25/7/2024	(3.365)	34.672
EUR 7.980.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 9/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024	JP Morgan	7/8/2024	(1.702)	22.238
EUR 7.920.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 29/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024	JP Morgan	27/8/2024	(2.250)	23.886
USD 529.100	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,235% Fixed semi-annually from 17/12/2026; and pays Floating USD SOFR annually from 17/6/2027	Barclays	15/6/2026	(5.574)	17.857
USD 529.100	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 17/6/2027; and pays 3,235% Fixed semi-annually from 17/12/2026	Barclays	15/6/2026	7.604	31.036
USD 624.500	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 22/7/2027; and pays 3,211% Fixed semi-annually from 22/1/2027	Barclays	20/7/2026	10.115	37.467
USD 624.500	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,211% Fixed semi-annually from 22/1/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 22/7/2027	Barclays	20/7/2026	(6.474)	20.878
USD 1.199.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 22/7/2027; and pays 3,225% Fixed semi-annually from 22/1/2027	Barclays	20/7/2026	18.826	71.300
USD 1.199.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,225% Fixed semi-annually from 22/1/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 22/7/2027	Barclays	20/7/2026	(11.885)	40.589
USD 1.069.200	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,582% Fixed semi-annually from 5/2/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 5/8/2027	Barclays	3/8/2026	(1.305)	49.125
USD 1.069.200	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 5/8/2027; and pays 3,582% Fixed semi-annually from 5/2/2027	Barclays	3/8/2026	231	50.662
USD 4.133.865	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 13/8/2027; and pays 3,63% Fixed semi-annually from 13/2/2027	Barclays	11/8/2026	(6.840)	190.270
USD 4.133.865	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,63% Fixed semi-annually from 13/2/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 13/8/2027	Barclays	11/8/2026	557	197.667
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 61.880.200)				(657.950)	1.008.364

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
USD (840.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,39% Fixed semi-annually from 7/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 7/9/2024	JP Morgan	5/9/2023	(3.997)	(6.117)
USD (840.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,605% Fixed semi-annually from 7/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 7/9/2024	Barclays	5/9/2023	(808)	(3.062)
USD (23.195.607)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 8/9/2024; and pays 3,6% Fixed semi-annually from 8/3/2024	Morgan Stanley	6/9/2023	74.111	(88)
USD (7.803.464)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 14/9/2024; and pays 3,3% Fixed semi-annually from 14/3/2024	Citibank	12/9/2023	18.694	(14)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
USD (2.346.146)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 15/9/2024; and pays 3,1% Fixed semi-annually from 15/3/2024	Citibank	13/9/2023	3.982	-
USD (400.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Goldman Sachs	20/9/2023	208	(77)
USD (400.000)	Fund writes a put option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating CDX.NA.HY.40.V1 quarterly from 20/6/2023; and pays 5% Fixed	Barclays	20/9/2023	102	(101)
EUR (640.000)	Fund writes a call option to enter into a Credit Default Swap. If exercised Fund receives Floating ITRAXX.XO.39.V1 quarterly from 20/6/2028; and pays 5% Fixed	Morgan Stanley	20/9/2023	(3.045)	(13.168)
USD (3.756.513)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,93% Fixed semi-annually from 4/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 4/10/2024	Goldman Sachs	2/10/2023	1.198	(23.920)
USD (5.089.745)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,5% Fixed semi-annually from 17/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 17/10/2024	Goldman Sachs	13/10/2023	(89.786)	(137.396)
USD (22.055.561)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,25% Fixed semi-annually from 17/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 17/10/2024	Citibank	13/10/2023	(146.854)	(189.212)
USD (11.668.536)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,05% Fixed semi-annually from 18/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/10/2024	Goldman Sachs	16/10/2023	(105.997)	(136.307)
USD (10.181.475)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,25% Fixed semi-annually from 19/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 19/10/2024	Citibank	17/10/2023	(58.066)	(87.400)
USD (2.111.028)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,3% Fixed annually from 23/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 23/10/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	(3.330)	(10.135)
USD (4.222.056)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 23/10/2024; and pays 2,45% Fixed annually from 23/4/2024	Goldman Sachs	19/10/2023	10.400	(192)
USD (13.062.968)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 26/10/2024; and pays 3,09% Fixed semi-annually from 26/4/2024	Citibank	24/10/2023	59.619	(417)
USD (7.888.880)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,4% Fixed semi-annually from 30/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 31/10/2024	Goldman Sachs	27/10/2023	13.466	(18.065)
USD (7.778.663)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Citibank	1/11/2023	5.082	(9.081)
USD (1.555.733)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Goldman Sachs	1/11/2023	11.049	(7.899)
USD (31.223.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,8% Fixed semi-annually from 10/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 10/11/2024	Goldman Sachs	8/11/2023	(14.442)	(75.254)
USD (23.537.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,85% Fixed semi-annually from 14/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/11/2024	JP Morgan	10/11/2023	(16.278)	(48.262)
USD (4.095.001)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	1.939	(11.580)
USD (10.237.501)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 16/11/2024; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 16/5/2024	Citibank	14/11/2023	34.107	(543)
USD (6.410.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,9% Fixed semi-annually from 5/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 5/12/2024	Citibank	1/12/2023	(43.597)	(81.955)
USD (1.272.083)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,9% Fixed semi-annually from 15/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/12/2024	JP Morgan	13/12/2023	(6.384)	(14.635)
USD (1.272.083)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 15/6/2024; and pays 2,9% Fixed semi-annually from 15/12/2024	JP Morgan	13/12/2023	8.697	(1.027)
USD (1.821.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 18/12/2024; and pays 2,4% Fixed semi-annually from 18/6/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	30.654	(483)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR	Valeur de marché EUR
USD (1.821.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 18/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/12/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	(12.250)	(45.611)
JPY (95.545.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 24/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 24/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(1.518)	(4.268)
JPY (59.237.900)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 22/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(937)	(2.646)
JPY (36.307.100)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 22/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(578)	(1.622)
USD (3.949.131)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,5% Fixed semi-annually from 9/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/1/2025	Citibank	5/1/2024	8.048	(14.576)
USD (6.410.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 19/1/2025; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 19/7/2024	Citibank	17/1/2024	30.959	(2.715)
USD (16.822.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 24/1/2025; and pays 3,8% Fixed semi-annually from 24/7/2024	Citibank	22/1/2024	9.530	(6.356)
USD (16.822.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 26/1/2025; and pays 3,85% Fixed semi-annually from 26/7/2024	Citibank	24/1/2024	7.046	(7.218)
USD (62.168.821)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 14/2/2025; and pays 3,75% Fixed semi-annually from 14/8/2024	Citibank	12/2/2024	16.921	(33.890)
USD (10.944.848)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,79% Fixed semi-annually from 1/10/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 1/4/2025	JP Morgan	27/3/2024	(65.537)	(170.179)
USD (10.130.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,495% Fixed semi-annually from 29/1/2025; and pays Floating USD SOFR annually from 29/7/2025	JP Morgan	25/7/2024	(326)	(38.291)
EUR (7.980.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 9/8/2024	JP Morgan	7/8/2024	812	(7.248)
USD (230.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 16/8/2025; and pays 3,7% Fixed semi-annually from 16/2/2025	Nomura	14/8/2024	201	(7.466)
USD (230.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,7% Fixed semi-annually from 16/2/2025; and pays Floating USD SOFR annually from 16/8/2025	Nomura	14/8/2024	939	(6.728)
EUR (7.920.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 29/8/2025	JP Morgan	27/8/2024	(781)	(8.067)
USD (2.414.744)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/9/2026; and pays 3,585% Fixed semi-annually from 3/3/2026	Bank of America	29/8/2025	(279)	(99.774)
USD (2.414.744)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,585% Fixed semi-annually from 3/3/2026; and pays Floating USD SOFR annually from 3/9/2026	Bank of America	29/8/2025	(738)	(100.233)
EUR (20.358.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,5% Fixed annually from 28/7/2028; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 28/1/2028	Goldman Sachs	26/7/2027	(121.267)	(451.066)
EUR (12.000.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,08% Fixed annually from 27/9/2028; and pays Floating EUR EURIBOR annually from 27/3/2028	Citibank	23/9/2027	86.155	(188.645)
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 106.194.922)				(262.876)	(2.072.989)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund suite

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-values/ (moins-values) non réalisées EUR
Bermudes			
(134.500)	Luye Pharma	HSBC Bank	5.374
			5.374
Îles Caïmans			
(10.100)	iQIYI	HSBC Bank	8.611
			8.611
Japon			
(3.800)	Tokyu	HSBC Bank	(1.378)
			(1.378)
Corée du Sud			
200	SK Hynix	HSBC Bank	6
			6
Total (EUR Exposition sous-jacente - EUR 153.301)			12.613

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché EUR	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 12.502.600	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	9.931.117	1,96
USD 41.466.094	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	34.145.561	6,74
USD (3.500.000)	Fannie Mae or Freddie Mac 2,5% TBA	(2.675.879)	(0,53)
USD (898.300)	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	(764.224)	(0,15)
USD (6.150.733)	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	(5.376.423)	(1,06)
USD 20.111.336	Fannie Mae or Freddie Mac 5,5% TBA	18.312.389	3,62
USD 1.843.000	Fannie Mae or Freddie Mac 6,5% TBA	1.725.002	0,34
USD (6.730.680)	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	(6.016.736)	(1,19)
Total TBA (EUR Exposition sous-jacente - EUR 78.947.330)		49.280.807	9,73

Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				1.675	ASML	1.115.630	1,16
				73.960	ING Groep	1.061.930	1,11
						2.587.657	2,70
ACTIONS ORDINAIRES							
Bermudes				Corée du Sud			
4.768	Bunge	546.842	0,57	3.155	SK Hynix	290.735	0,30
Canada				Espagne			
9.743	Cameco	362.537	0,38	13.297	Cellnex Telecom	512.718	0,53
14.084	Enbridge	498.457	0,52	Suisse			
				6.069	Alcon	509.868	0,53
				310	Lonza	172.548	0,18
				9.620	Nestle	1.162.622	1,21
				2.833	TE Connectivity	376.534	0,39
						2.221.572	2,31
Chine				Taiwan			
11.500	BYD	360.412	0,38	5.903	Taiwan Semiconductor Manufacturing	554.115	0,58
Curaçao				Royaume-Uni			
3.972	Schlumberger	233.713	0,24	5.655	AstraZeneca	770.907	0,80
Finlande				60.561	Barclays	114.096	0,12
10.606	Neste	388.704	0,40	9.984	Compass	254.613	0,27
France				74.945	Lloyds Banking	40.429	0,04
2.255	Accor	81.275	0,09	11.250	RELX	368.221	0,38
8.854	BNP Paribas	576.847	0,60	16.813	Unilever	868.824	0,91
11.467	Cie de Saint-Gobain	746.837	0,78			2.417.090	2,52
4.291	Danone	252.793	0,26	États-Unis			
3.002	EssilorLuxottica	572.842	0,60	8.644	Abbott Laboratories	902.434	0,94
840	Kering	454.264	0,47	2.930	Advanced Micro Devices	314.682	0,33
616	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	530.651	0,55	1.682	Air Products and Chemicals	497.451	0,52
1.651	Sanofi	178.247	0,19	892	Albemarle	177.374	0,18
2.982	Schneider Electric	515.967	0,54	12.002	Alphabet	1.654.236	1,72
1.922	Vinci	216.117	0,22	5.979	Amazon.com	823.667	0,86
				4.229	American Tower	771.919	0,81
				6.745	Apple	1.268.465	1,32
				4.360	Applied Materials	662.502	0,69
				11.112	Archer-Daniels-Midland	892.627	0,93
				12.911	Boston Scientific	703.133	0,73
				8.644	Carrier Global	498.845	0,52
				2.609	CF Industries	200.606	0,21
				1.109	Costco Wholesale	603.407	0,63
				906	Deere	375.093	0,39
				10.306	Delta Air Lines	442.643	0,46
				1.869	Dexcom	192.526	0,20
				6.168	Edwards Lifesciences	478.452	0,50
				2.527	Eli Lilly	1.387.323	1,45
				31	First Solar	5.846	0,01
				822	Ford Motor	9.987	0,01
				8.673	Fortive	686.728	0,72
				3.029	Freeport-McMoRan	122.069	0,13
				4.147	Hilton Worldwide	622.548	0,65
				290	Home Depot	96.239	0,10
				1.468	Humana	692.529	0,72
				2.125	Ingersoll Rand	148.538	0,15
				474	Intuit	256.448	0,27
				2.165	Intuitive Surgical	693.146	0,72
				2.299	JPMorgan Chase	339.815	0,35
				278	Lennar	33.057	0,04
				431	Lowe's	99.557	0,10
				2.781	LPL Financial	650.114	0,68
				6.558	Marsh & McLennan	1.288.778	1,34
				3.548	Mastercard	1.470.575	1,53
				7.565	Merck	831.469	0,87
				3.515	Micron Technology	246.964	0,26
				7.850	Microsoft	2.583.121	2,69
				200	Morgan Stanley	17.070	0,02
				9.568	NextEra Energy	646.127	0,67
Japon							
26.200	FANUC	744.474	0,78				
12.600	Honda Motor	405.445	0,42				
2.300	Hoya	254.227	0,27				
17.700	Japan Airlines	363.434	0,38				
1.100	Keyence	455.489	0,47				
4.800	Komatsu	136.294	0,14				
4.300	Sysmex	228.041	0,24				
21.300	Toyota Motor	366.525	0,38				
						2.953.929	3,08
Jersey							
5.352	Aptiv	545.208	0,57				
Pays-Bas							
141	Adyen	119.185	0,13				
3.559	Akzo Nobel	290.912	0,30				

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
États-Unis			
USD 266.000	AT&T 0% 21/2/2024	258.593	0,27
USD 1.500.000	AT&T 0% 23/2/2024	1.457.734	1,52
		1.716.327	1,79
	Total des billets de trésorerie	3.214.997	3,35
	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	84.498.343	88,09
	Total du portefeuille	84.498.343	88,09
	Autres éléments de l'actif net	11.422.850	11,91
	Total de l'actif net (USD)	95.921.193	100,00

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	1.718.340	USD	1.162.933	JP Morgan	20/9/2023	(49.220)
AUD	490.381	USD	337.439	RBS	20/9/2023	(19.607)
BRL	3.690.879	USD	738.486	Barclays	20/9/2023	8.702
BRL	1.219.877	USD	249.785	Morgan Stanley	20/9/2023	(2.831)
CAD	2.644.005	USD	1.979.345	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(24.478)
CAD	304.541	USD	230.281	RBS	20/9/2023	(5.116)
CHF	335.330	USD	372.447	Royal Bank of Canada	20/9/2023	7.886
CNH	1.674.204	USD	236.876	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(6.566)
CNH	1.674.204	USD	236.653	State Street	20/9/2023	(6.342)
CNH	9.492.461	USD	1.333.910	Bank of America	20/9/2023	(28.087)
CNH	1.992.119	USD	281.127	Barclays	20/9/2023	(7.083)
CNH	1.037.985	USD	143.632	JP Morgan	20/9/2023	(842)
CNH	1.734.621	USD	240.462	RBS	20/9/2023	(1.840)
CNY	7.552.214	USD	1.070.001	BNP Paribas	20/9/2023	(27.878)
EUR	1.550.221	USD	1.700.461	Barclays	20/9/2023	(17.252)
EUR	262.484	USD	290.476	JP Morgan	20/9/2023	(5.475)
GBP	452.686	USD	574.312	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(422)
IDR	8.320.190.123	USD	556.330	Citigroup	20/9/2023	(10.141)
INR	36.654.398	USD	442.801	Citigroup	20/9/2023	(58)
INR	27.537.556	USD	334.763	State Street	20/9/2023	(2.141)
INR	7.813.300	USD	94.170	JP Morgan	20/9/2023	206
JPY	947.633.902	USD	6.887.571	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(387.180)
JPY	27.561.261	USD	196.190	JP Morgan	20/9/2023	(7.131)
KRW	677.530.921	USD	525.055	JP Morgan	20/9/2023	(12.375)
KRW	452.521.175	USD	356.813	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(14.395)
MXN	16.504.796	USD	936.071	Goldman Sachs	20/9/2023	47.408
MXN	1.732.861	USD	98.886	Morgan Stanley	20/9/2023	4.371
USD	610.946	EUR	557.652	JP Morgan	20/9/2023	5.455
USD	694.308	JPY	96.227.306	Morgan Stanley	20/9/2023	34.227
USD	337.918	GBP	264.891	State Street	20/9/2023	2.104
USD	481.665	JPY	68.648.568	RBS	20/9/2023	10.763
USD	341.766	EUR	306.021	BNP Paribas	20/9/2023	9.492
USD	243.393	MXN	4.167.629	JP Morgan	20/9/2023	(4.946)
USD	393.664	BRL	1.891.664	Goldman Sachs	20/9/2023	10.712
USD	199.472	MXN	3.420.446	HSBC Bank	20/9/2023	(4.344)
USD	246.177	EUR	222.405	Morgan Stanley	20/9/2023	4.693

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	196.620	IDR	2.989.924.280	Morgan Stanley	20/9/2023	343
USD	350.000	JPY	50.977.885	Royal Bank of Canada	20/9/2023	312
USD	328.308	JPY	47.754.565	Barclays	20/9/2023	731
ZAR	1.674.994	USD	89.286	Morgan Stanley	20/9/2023	(269)
Moins-value nette non réalisée						(498.614)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	29.092	USD	31.917	BNY Mellon	15/9/2023	(337)
USD	999	EUR	915	BNY Mellon	15/9/2023	6
Moins-value nette non réalisée						(331)
Catégorie d'Actions couverte en SEK						
SEK	56.258	USD	5.263	BNY Mellon	15/9/2023	(103)
USD	190	SEK	2.081	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(103)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 25.494.491)						(499.048)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
12	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	1.510.634	(1.432)
23	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	3.318.848	(35.684)
3	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	415.675	(3.678)
3	JPY	Nikkei 225 Index	Septembre 2023	670.384	5.542
4	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	188.216	(412)
(6)	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	1.360.725	(15.271)
(8)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	972.500	(9.250)
7	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	776.234	5.393
(2)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	231.969	(1.745)
10	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	1.208.451	10.141
1	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	203.672	289
148	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	15.807.094	42.477
Total				26.664.402	(3.630)

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	MXN 14.426.515	Fund receives Fixed 9,775%; and pays Floating MXN MXIBTIII 1 Month	Barclays	4/2/2025	(8.877)	(8.877)
IRS	MXN 7.213.257	Fund receives Fixed 9,785%; and pays Floating MXN MXIBTIII 1 Month	Barclays	4/2/2025	(4.381)	(4.381)
IRS	MXN 7.213.257	Fund receives Fixed 9,8%; and pays Floating MXN MXIBTIII 1 Month	Barclays	4/2/2025	(4.295)	(4.295)
IRS	BRL 1.202.000	Fund receives Fixed 10,3164%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	4/1/2027	572	572
IRS	MXN 9.000.000	Fund receives Fixed 8,2%; and pays Floating MXN MXIBTIII 1 Month	Barclays	5/1/2028	(16.092)	(16.092)
IRS	MXN 4.328.000	Fund receives Fixed 9,1343%; and pays Floating MXN MXIBTIII 1 Month	Barclays	15/8/2028	2.181	2.181
IRS	BRL 662.528	Fund receives Fixed 10,0325%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(1.179)	(1.179)
IRS	BRL 5.030	Fund receives Fixed 10,12%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(6)	(6)

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾ suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	BRL 901.048	Fund receives Fixed 10,1225%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(1.110)	(1.110)
IRS	BRL 939.129	Fund receives Fixed 10,12%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(1.172)	(1.172)
IRS	BRL 3.000.000	Fund receives Fixed 12,43%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	40.690	40.690
IRS	BRL 603.226	Fund receives Fixed 9,965%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(1.099)	(1.099)
IRS	BRL 1.149.233	Fund receives Fixed 13,22%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2025	7.781	7.781
IRS	BRL 704.787	Fund receives Fixed 10,1%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(969)	(969)
IRS	BRL 587.198	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(1.125)	(1.125)
IRS	BRL 1.882.831	Fund receives Fixed 10,05%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(3.141)	(3.141)
IRS	BRL 2.185.722	Fund receives Fixed 13,15%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2025	14.222	14.222
IRS	BRL 2.184.621	Fund receives Fixed 13,18%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2025	14.462	14.462
IRS	BRL 585.845	Fund receives Fixed 10,025%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	(848)	(848)
IRS	BRL 586.475	Fund receives Fixed 9,99%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	4/1/2027	(977)	(977)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 5.999.528)					34.637	34.637

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
241.000	Put	OTC USD/INR	Citibank	USD 82	9/10/2023	(200)	302
2.626.553	Call	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 8,5	21/8/2024	(3.143)	725
954.288	Put	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,099	25/9/2023	7.138	15.160
18.600	Put	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1,06	20/10/2023	3.219	6.315
530.300	Call	OTC USD/HKD	Morgan Stanley	USD 7,81	13/11/2023	252	1.231
43	Call	NASDAQ 100 Index	UBS	USD 15.700	15/9/2023	(1.939)	5.952
3	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	(1.680)	306
5	Call	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	(4.769)	43
2	Call	Albemarle	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(1.184)	90
10	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	9.073	13.200
11	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	5.389	9.322
8	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(1.010)	3.700
9	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	15/9/2023	(3.102)	563
12	Call	Apple	Exchange Traded	USD 195	15/9/2023	(5.469)	942
6	Call	Apple	Exchange Traded	USD 200	15/9/2023	(2.416)	165
13	Call	Apple	Exchange Traded	USD 205	15/9/2023	(3.454)	150
4	Call	Applied Materials	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	2.838	5.040
9	Call	Archer-Daniels-Midland	Exchange Traded	USD 82,5	15/9/2023	(1.190)	360
5	Call	Edwards Lifesciences	Exchange Traded	USD 85	15/9/2023	(1.353)	50
2	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	14.921	17.990
2	Call	Humana	Exchange Traded	USD 450	15/9/2023	3.148	5.020
1	Call	Humana	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	162	1.595
16	Call	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	(3.059)	56
4	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 360	15/9/2023	(4.153)	102
7	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 355	15/9/2023	(8.267)	284
9	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 365	15/9/2023	(9.098)	158
8	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	35.202	55.180
1	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	109	2.682

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾ suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
1	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 485	15/9/2023	(675)	2.360
5	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(5.063)	7.737
3	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 470	15/9/2023	2.468	10.170
1	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 230	15/9/2023	(866)	323
1	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 240	15/9/2023	(764)	81
1	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 275	15/9/2023	(923)	348
1	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 280	15/9/2023	(1.515)	258
3	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 290	15/9/2023	(5.269)	423
7	Call	UniCredit	Exchange Traded	EUR 23	15/9/2023	(1.503)	1.339
5	Call	Vinci	Exchange Traded	EUR 110	15/9/2023	(1.107)	43
3	Call	Walt Disney	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	(827)	47
16	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	2.845	11.600
13	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(4.048)	3.776
7	Call	Apple	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	5.440	8.155
3	Call	Apple	Exchange Traded	USD 185	20/10/2023	1.505	2.407
5	Call	Bunge	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	3.664	5.900
19	Call	Micron Technology	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	4.412	7.885
3	Call	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 320	20/10/2023	(149)	2.430
18	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 463	20/10/2023	721	6.795
16	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(1.363)	1.952
2	Call	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 530	20/10/2023	(2.123)	511
9	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/11/2023	237	3.847
1	Call	Broadcom	Exchange Traded	USD 900	17/11/2023	2.285	6.370
3	Call	Humana	Exchange Traded	USD 520	17/11/2023	(3.757)	1.500
56	Call	Kenvue	Exchange Traded	USD 25	17/11/2023	(1.105)	3.220
4	Call	Lennar	Exchange Traded	USD 135	17/11/2023	(1.995)	590
9	Call	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 140	17/11/2023	325	4.432
3	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 440	15/12/2023	12.953	25.710
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 3.820.723)						29.768	266.892

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(954.288)	Put	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,079	25/9/2023	(1.607)	(4.703)
(265.700)	Call	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1,11	20/10/2023	188	(539)
(4)	Put	Albemarle	Exchange Traded	USD 180	15/9/2023	1.160	(220)
(20)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(5.895)	(8.900)
(16)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(613)	(2.688)
(18)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	2.939	(351)
(13)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	1.575	(46)
(10)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	823	(305)
(6)	Call	Applied Materials	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	(1.431)	(2.835)
(3)	Call	CF Industries	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	441	(30)
(2)	Call	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(9.459)	(10.125)
(1)	Call	Humana	Exchange Traded	USD 490	15/9/2023	361	(188)
(16)	Call	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 170	15/9/2023	581	(24)
(5)	Call	Micron Technology	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	519	(28)
(7)	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 380	15/9/2023	3.386	(39)
(4)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	15/9/2023	1.205	(126)
(4)	Put	Microsoft	Exchange Traded	USD 320	15/9/2023	1.152	(872)
(1)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	707	(255)
(1)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 560	15/9/2023	961	(172)
(3)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 600	15/9/2023	2.329	(119)
(4)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 540	15/9/2023	2.787	(1.520)
(6)	Put	NVIDIA	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	7.567	(168)
(2)	Call	Salesforce	Exchange Traded	USD 250	15/9/2023	855	(42)

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾ suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(2)	Call	Tesla	Exchange Traded	USD 305	15/9/2023	1.009	(121)
(5)	Put	Tesla	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	1.556	(333)
(7)	Put	UniCredit	Exchange Traded	EUR 20	15/9/2023	1.405	(150)
(5)	Put	Vinci	Exchange Traded	EUR 100	15/9/2023	441	(222)
(5)	Call	Walt Disney	Exchange Traded	USD 95	15/9/2023	697	(28)
(16)	Call	Alphabet	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(756)	(4.048)
(16)	Put	Alphabet	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	1.476	(568)
(13)	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	1.706	(578)
(13)	Put	Amazon.com	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	999	(988)
(10)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	1.494	(435)
(5)	Call	Bunge	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	(506)	(875)
(19)	Put	Micron Technology	Exchange Traded	USD 52,5	20/10/2023	1.300	(389)
(3)	Call	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 350	20/10/2023	166	(360)
(3)	Put	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 270	20/10/2023	412	(352)
(16)	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 57,5	20/10/2023	564	(264)
(16)	Put	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 37,5	20/10/2023	356	(296)
(2)	Call	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 560	20/10/2023	778	(108)
(2)	Put	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 450	20/10/2023	(89)	(745)
(9)	Put	Amazon.com	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	615	(1.345)
(1)	Put	Broadcom	Exchange Traded	USD 760	17/11/2023	1.183	(930)
(3)	Call	Humana	Exchange Traded	USD 560	17/11/2023	1.418	(375)
(3)	Put	Humana	Exchange Traded	USD 440	17/11/2023	(562)	(2.385)
(56)	Put	Kenvue	Exchange Traded	USD 20	17/11/2023	267	(980)
(4)	Put	Lennar	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(716)	(1.780)
(6)	Call	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 82,5	17/11/2023	293	(60)
(6)	Put	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 65	17/11/2023	(154)	(885)
(9)	Put	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(274)	(1.174)
(3)	Call	NVIDIA	Exchange Traded	USD 530	15/12/2023	(6.382)	(11.895)
(3)	Put	NVIDIA	Exchange Traded	USD 310	15/12/2023	2.809	(514)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 1.392.294)						22.036	(67.478)

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD 1.350.491	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,65% Fixed semi-annually from 14/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/9/2024	Citibank	12/9/2023	(8.840)	195
USD 404.973	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 15/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/9/2024	Citibank	13/9/2023	(3.107)	44
USD 271.854	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/11/2024; and pays 3,65% Fixed semi-annually from 3/5/2024	Citibank	1/11/2023	1.464	5.043
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 182.865)				(10.483)	5.282

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (1.350.491)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 14/9/2024; and pays 3,3% Fixed semi-annually from 14/3/2024	Citibank	12/9/2023	3.590	(3)
USD (404.973)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 15/9/2024; and pays 3,1% Fixed semi-annually from 15/3/2024	Citibank	13/9/2023	769	-

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾ suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (1.374.825)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,4% Fixed semi-annually from 30/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 31/10/2024	Goldman Sachs	27/10/2023	2.633	(3.416)
USD (1.359.268)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Citibank	1/11/2023	997	(1.722)
USD (271.854)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Goldman Sachs	1/11/2023	2.118	(1.497)
USD (5.411.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,8% Fixed semi-annually from 10/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 10/11/2024	Goldman Sachs	8/11/2023	(2.624)	(14.149)
USD (4.045.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,85% Fixed semi-annually from 14/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/11/2024	JP Morgan	10/11/2023	(2.931)	(8.999)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 3.552.811)				4.552	(29.786)

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 971.333	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	867.795	0,90
USD 1.138.828	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	1.080.021	1,13
USD 3.551.000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	3.443.979	3,59
Total TBA (USD Exposition sous-jacente - USD 5.391.796)		5.391.795	5,62

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Irlande							
1.250	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF-	55.638	0,05				
Total des Compartiments		55.638	0,05				
ACTIONS ORDINAIRES							
Canada							
575	Enbridge	20.352	0,02				
Curaçao							
17	Schlumberger	1.000	0,00				
France							
50	BNP Paribas	3.258	0,01				
Allemagne							
42	Mercedes-Benz	3.094	0,00				
Pays-Bas							
3	ASML	1.996	0,00				
5	NXP Semiconductors	1.031	0,00				
		3.027	0,00				
Taiwan							
15	Taiwan Semiconductor Manufacturing	1.408	0,00				
Royaume-Uni							
3.397	Barclays	6.400	0,01				
1.149	BP	7.144	0,01				
599	Rio Tinto	37.176	0,03				
		50.720	0,05				
États-Unis							
48	Activision Blizzard	4.416	0,01				
14	Advanced Micro Devices	1.504	0,00				
10	Alphabet	1.378	0,00				
16	Applied Materials	2.431	0,00				
4.144	Astra Space	1.096	0,00				
4	Broadcom	3.647	0,00				
7	Constellation Brands	1.822	0,00				
164	Delta Air Lines	7.044	0,01				
5	Eli Lilly	2.745	0,00				
8	First Solar	1.509	0,00				
331	Ford Motor	4.022	0,00				
118	General Motors	3.958	0,00				
112	Hilton Worldwide	16.813	0,02				
5	KLA	2.508	0,00				
23	Lennar	2.735	0,00				
51	M/I Homes	4.981	0,01				
31	Meritage Homes	4.286	0,00				
13	Microchip Technology	1.072	0,00				
58	Micron Technology	4.075	0,01				
22	NVIDIA	10.938	0,01				
25	Rockwell Automation	7.805	0,01				
100	Uber Technologies	4.678	0,01				
98	United Airlines	4.890	0,00				
		100.353	0,09				
Total des actions ordinaires		183.212	0,17				
OBLIGATIONS							
Australie							
USD 83.000	FMG Resources August 2006 6,125% 15/4/2032	77.285	0,07				
				Autriche			
USD 200.000	Klabn Austria 3,2% 12/1/2031	160.296	0,14				
USD 81.000	Suzano Austria 3,125% 15/1/2032	63.896	0,05				
		224.192	0,19				
				Bahreïn			
USD 210.000	Bahrain Government International Bond 6,75% 20/9/2029	210.044	0,19				
				Brésil			
BRL 558.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	112.422	0,10				
BRL 1.430.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	288.543	0,26				
		400.965	0,36				
				Îles Vierges britanniques			
EUR 100.000	Global Switch 2,25% 31/5/2027	100.994	0,09				
				Canada			
USD 13.000	Masonite International 5,375% 1/2/2028	12.277	0,01				
USD 75.000	Mattamy 5,25% 15/12/2027	70.604	0,06				
USD 100.000	Nutrien 4,9% 27/3/2028	97.683	0,09				
USD 650.000	Rogers Communications 3,8% 15/3/2032	554.569	0,50				
		735.133	0,66				
				Îles Caïmans			
USD 250.000	AGL CLO 11 11,93% 15/4/2034	245.285	0,22				
USD 250.000	AGL CLO 3 8,87% 15/1/2033	247.202	0,22				
USD 250.000	AGL CLO 7 8,67% 15/7/2034	243.995	0,22				
USD 275.000	AGL CLO 9 9,288% 20/1/2034	272.477	0,25				
USD 250.000	AIMCO CLO Series 2017-A 8,738% 20/4/2034	239.862	0,22				
USD 350.000	Apidos CLO XXXII 9,088% 20/1/2033	345.810	0,31				
USD 500.000	Bain Capital Credit CLO 2021-3 8,707% 24/7/2034	477.721	0,43				
USD 250.000	Bardot CLO 8,607% 22/10/2032	244.870	0,22				
USD 250.000	CarVal CLO I 8,46% 16/7/2031	243.726	0,22				
USD 700.000	CIFC Funding 2014-II-R 8,407% 24/4/2030	693.097	0,62				
USD 800.000	CIFC Funding 2017-I 7,295% 23/4/2029	797.688	0,72				
USD 233.919	CIFC Funding 2017-IV 6,557% 24/10/2030	232.569	0,21				
USD 300.000	CIFC Funding 2017-V 8,42% 16/11/2030	293.977	0,26				
USD 491.000	CIFC Funding 2018-I 6,572% 18/4/2031	489.404	0,44				
USD 250.000	CIFC Funding 2018-V 8,57% 15/1/2032	247.169	0,22				
USD 500.000	Generate CLO 2 9,188% 20/10/2029	497.799	0,45				
USD 250.000	Gilbert Park CLO 8,52% 15/10/2030	240.851	0,22				
USD 250.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 7,138% 20/10/2032	249.321	0,22				
USD 500.000	GoldenTree Loan Opportunities IX 11,291% 29/10/2029	485.139	0,44				
USD 250.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 10,938% 20/10/2034	235.381	0,21				

^ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 100.000	TK Elevator Midco 4,375% 15/7/2027*	99.071	0,09	EUR 100.000	doValue 3,375% 31/7/2026	92.949	0,08
EUR 100.000	ZF Finance 3,75% 21/9/2028	98.671	0,09	EUR 200.000	Enel 6,625% 16/4/2031*	221.817	0,20
EUR 700.000	ZF Finance 5,75% 3/8/2026	764.770	0,68	EUR 100.000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11,125% 15/5/2028	108.465	0,10
		3.508.674	3,15	EUR 100.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,625% 21/10/2028	95.688	0,09
	Guatemala			GBP 100.000	Intesa Sanpaolo 5,148% 10/6/2030	106.426	0,09
USD 200.000	Guatemala Government Bond 4,65% 7/10/2041	157.620	0,14	EUR 100.000	Nexi 0% 24/2/2028	84.884	0,08
USD 200.000	Guatemala Government Bond 5,25% 10/8/2029*	190.556	0,17	EUR 200.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	219.427	0,19
		348.176	0,31			1.852.441	1,66
	Hongrie				Japon		
USD 200.000	Hungary Government International Bond 5,25% 16/6/2029	195.784	0,18	USD 200.000	Mizuho Financial 3,261% 22/5/2030	175.688	0,16
USD 28.000	Hungary Government International Bond 5,375% 25/3/2024	27.952	0,02	EUR 100.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032	85.000	0,08
		223.736	0,20	USD 200.000	Sumitomo Mitsui Financial 2,472% 14/1/2029	171.321	0,15
				USD 205.000	Takeda Pharmaceutical 2,05% 31/3/2030	168.581	0,15
						600.590	0,54
	Indonésie				Jersey		
USD 200.000	Freeport Indonesia 4,763% 14/4/2027	192.980	0,17	USD 202.000	Aptiv 3,1% 1/12/2051	123.293	0,11
USD 200.000	Indonesia Government International Bond 6,75% 15/1/2044*	229.332	0,21	USD 130.000	Aptiv / Aptiv 3,25% 1/3/2032	110.265	0,10
IDR 2.255.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,125% 15/6/2038	157.169	0,14	GBP 100.000	Galaxy Bidco 6,5% 31/7/2026	116.763	0,11
IDR 1.679.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2036	125.283	0,11	GBP 5.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 5,844% 5/11/2031	6.344	0,01
USD 200.000	Pertamina Persero 3,65% 30/7/2029	183.218	0,17			356.665	0,33
USD 200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4,4% 6/6/2027	195.744	0,18		Luxembourg		
		1.083.726	0,98	USD 258.000	Altice Financing 5% 15/1/2028	210.214	0,19
				USD 432.000	Altice Financing 5,75% 15/8/2029	342.759	0,31
				GBP 100.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	112.022	0,10
	Irlande			EUR 100.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	111.270	0,10
GBP 100.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4,75% 15/7/2027	100.093	0,09	USD 200.000	EIG Pearl 3,545% 31/8/2036*	166.637	0,15
USD 250.000	Bank of Ireland 6,253% 16/9/2026	249.602	0,22	EUR 100.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	84.068	0,08
EUR 250.000	CIFC European Funding CLO III 7,263% 15/1/2034	257.976	0,23	USD 193.250	MC Brazil Downstream Trading 7,25% 30/6/2031	125.504	0,11
GBP 400.000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 7,486% 17/8/2033	507.123	0,46	USD 180.000	Millicom International Cellular 5,125% 15/1/2028*	162.112	0,15
GBP 212.000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 8,636% 17/8/2033	268.809	0,24	USD 200.000	Nexa Resources 5,375% 4/5/2027	187.087	0,17
		1.383.603	1,24	EUR 100.000	SES 2,875% 27/5/2026	94.624	0,08
						1.596.297	1,44
	Île de Man				Maurice		
USD 200.000	AngloGold Ashanti 3,75% 1/10/2030	166.360	0,15	USD 200.000	HTA 7% 18/12/2025	189.804	0,17
				USD 250.000	India Green Energy 5,375% 29/4/2024*	246.250	0,22
						436.054	0,39
	Israël				Mexique		
USD 200.000	Bank Leumi Le-Israel 3,275% 29/1/2031	180.204	0,16	USD 200.000	Banco Mercantil del Norte 5,875% 24/1/2027	176.610	0,16
USD 161.000	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033*	163.214	0,15	USD 200.000	BBVA Bancomer 5,125% 18/1/2033	173.121	0,16
		343.418	0,31	USD 275.000	Braskem Idesa SAPI 6,99% 20/2/2032*	164.130	0,15
	Italie			MXN 4.278.800	Mexican Bonos 7,5% 26/5/2033	226.074	0,20
EUR 500.000	AutoFlorence 3 4,592% 25/12/2046	544.412	0,49	MXN 4.688.900	Mexican Bonos 7,75% 29/5/2031	255.077	0,23
EUR 100.000	AutoFlorence 3 6,992% 25/12/2046	108.844	0,10	MXN 59.196.300	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	320.779	0,29
EUR 100.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	105.727	0,09	MXN 19.283.400	Mexico Cetes 0% 3/10/2024	102.475	0,09
EUR 150.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	163.802	0,15				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 200.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	165.614	0,15	USD 281.000	Panama Panama Government International Bond 3,16% 23/1/2030	244.544	0,22
USD 400.000	Mexico Government International Bond 3,75% 11/1/2028	379.490	0,34	USD 435.000	Panama Government International Bond 6,853% 28/3/2054*	443.178	0,40
USD 200.000	Trust Fibra Uno 5,25% 30/1/2026	193.393	0,17			687.722	0,62
		2.156.763	1,94				
	Pays-Bas			USD 200.000	Paraguay Paraguay Government International Bond 5,6% 13/3/2048	171.876	0,15
EUR 100.000	Abertis Infraestructuras Finance 3,248% 24/11/2025	98.519	0,09				
USD 200.000	ABN AMRO Bank 2,47% 13/12/2029	168.629	0,15	USD 200.000	Pérou Financiera de Desarrollo 4,75% 15/7/2025	196.153	0,18
USD 200.000	Braskem Netherlands Finance 8,5% 23/1/2081	200.211	0,18	USD 200.000	Peruvian Government International Bond 1,862% 1/12/2032	151.020	0,14
GBP 400.000	Enel Finance International 5,625% 14/8/2024	505.804	0,45	USD 228.000	Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031	193.571	0,17
EUR 100.000	Iberdrola International 1,825% 9/8/2029	85.005	0,08	USD 60.000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034*	48.738	0,04
USD 200.000	ING Groep 3,875% 16/5/2027	149.030	0,13	USD 200.000	SAN Miguel Industrias Pet SA / NG PET R&P Latin America 3,5% 2/8/2028	170.023	0,15
USD 200.000	ING Groep 4,625% 6/1/2026	195.201	0,18			759.505	0,68
EUR 100.000	Koninklijke KPN 2% 8/11/2024	103.536	0,09				
USD 250.000	MEGlobal 2,625% 28/4/2028*	220.794	0,20				
USD 200.000	MEGlobal 4,25% 3/11/2026	192.096	0,17				
USD 95.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2,65% 15/2/2032	76.100	0,07				
USD 147.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,25% 30/11/2051	95.122	0,08				
USD 400.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033	380.204	0,34				
EUR 90.000	OCI 3,625% 15/10/2025	94.951	0,08	USD 200.000	Philippines Philippine Government International Bond 2,95% 5/5/2045	138.514	0,12
EUR 100.000	OI European 2,875% 15/2/2025	106.141	0,10				
EUR 100.000	Phoenix PIB Dutch Finance 2,375% 5/8/2025	103.639	0,09				
EUR 560.000	Repsol International Finance 4,247% 11/9/2028*	553.040	0,50	EUR 115.000	Pologne Republic of Poland Government International Bond 4,25% 14/2/2043	121.963	0,11
EUR 500.000	Telefonica Europe 6,135% 3/2/2030	530.913	0,48	USD 70.000	Republic of Poland Government International Bond 5,75% 16/11/2032*	72.860	0,06
EUR 650.000	TenneT 2,995% 1/3/2024	696.928	0,63			194.823	0,17
EUR 350.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3,75% 9/5/2027	348.075	0,31				
EUR 190.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,375% 15/9/2029	211.607	0,19				
EUR 240.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,875% 15/9/2031	273.160	0,25	EUR 100.000	Portugal EDP - Energias de Portugal 5,943% 23/4/2083	107.627	0,10
USD 216.000	Trivium Packaging Finance 5,5% 15/8/2026	204.146	0,18				
USD 313.000	VZ Secured Financing 5% 15/1/2032	255.275	0,23	USD 24.655	Porto Rico Commonwealth of Puerto Rico 0% 1/11/2043	12.728	0,01
EUR 100.000	ZF Europe Finance 2,5% 23/10/2027	96.131	0,09	USD 116.517	Commonwealth of Puerto Rico 0% 1/11/2051	37.431	0,04
USD 216.000	Ziggo 4,875% 15/1/2030	181.710	0,16	USD 276.338	Commonwealth of Puerto Rico 0% 1/11/2051	115.026	0,10
USD 213.000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	198.384	0,18			165.185	0,15
		6.324.351	5,68				
	Oman			EUR 296.000	Roumanie Romanian Government International Bond 2,124% 16/7/2031*	244.655	0,22
USD 285.000	Oman Government International Bond 6,5% 8/3/2047	268.261	0,24	EUR 155.000	Romanian Government International Bond 2,5% 8/2/2030	140.787	0,12
USD 200.000	Oman Government International Bond 6,75% 17/1/2048	193.407	0,17	EUR 34.000	Romanian Government International Bond 2,875% 11/3/2029	32.557	0,03
		461.668	0,41				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 292.000	Romanian Government International Bond 5,25% 25/11/2027	286.969	0,26	EUR 100.000	Intrum 4,875% 15/8/2025	94.115	0,08
				USD 295.000	Swedbank 3,356% 4/4/2025	284.249	0,26
		704.968	0,63			425.467	0,38
	Arabie Saoudite				Suisse		
USD 257.000	Saudi Government International Bond 3,25% 17/11/2051	170.115	0,15	GBP 300.000	UBS 2,125% 12/9/2025	364.127	0,33
USD 300.000	Saudi Government International Bond 4,5% 17/4/2030	292.804	0,27	USD 200.000	UBS 3,875% 2/6/2026	164.696	0,15
		462.919	0,42	USD 550.000	UBS 5,711% 12/1/2027	547.626	0,49
						1.076.449	0,97
	Sénégal				Thaïlande		
USD 200.000	Senegal Government International Bond 6,25% 23/5/2033	164.062	0,15	USD 200.000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025	189.400	0,17
					Émirats arabes unis		
	Singapour			USD 220.000	DP World/United Arab Emirates 6,85% 2/7/2037	236.340	0,21
USD 178.250	Continuum Energy Levanter 4,5% 9/2/2027	166.441	0,15		Royaume-Uni		
USD 101.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	101.209	0,09	USD 58.134	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	50.923	0,04
		267.650	0,24	GBP 300.000	Barclays 6,375% 15/12/2025	337.987	0,30
				GBP 100.000	Bellis Acquisition 3,25% 16/2/2026	108.986	0,10
	Afrique du Sud			GBP 100.000	Bellis Acquisition 4,5% 16/2/2026	111.330	0,10
ZAR 1.020.027	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	48.711	0,04	EUR 300.000	BP Capital Markets 3,625% 22/3/2029	286.914	0,26
ZAR 225.888	Republic of South Africa Government Bond 8,25% 31/3/2032*	10.215	0,01	GBP 209.000	Brants Bridge 2023-1 5,952% 14/6/2066	264.258	0,24
ZAR 664.653	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 31/1/2044	25.745	0,02	GBP 100.000	British Telecommunications 8,375% 20/12/2083	126.964	0,12
ZAR 2.967.951	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	121.020	0,11	GBP 100.000	Constellation Automotive Financing 4,875% 15/7/2027	101.655	0,09
ZAR 3.162.568	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026	176.112	0,16	EUR 190.000	DS Smith 4,5% 27/7/2030	204.874	0,18
USD 200.000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	133.048	0,12	GBP 100.000	Heathrow Finance 3,875% 1/3/2027	109.412	0,10
USD 200.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,875% 20/4/2032	177.478	0,16	GBP 100.000	Hermitage 2023 7,646% 21/9/2033	126.886	0,11
		692.329	0,62	USD 600.000	HSBC 7,336% 3/11/2026	617.180	0,55
				EUR 100.000	INEOS Quattro Finance 2 2,5% 15/1/2026	98.944	0,09
	Espagne			USD 200.000	NatWest 7,472% 10/11/2026	205.810	0,19
EUR 100.000	Banco de Sabadell 2,625% 24/3/2026	104.581	0,09	GBP 271.000	Newday Partnership Master Issuer 7,986% 15/7/2031	345.251	0,31
EUR 100.000	Banco de Sabadell 5,25% 7/2/2029	107.852	0,10	GBP 282.000	Oat Hill NO 3 6,885% 29/5/2046	349.330	0,31
EUR 300.000	Banco Santander 3,625% 27/9/2026	321.658	0,29	GBP 145.000	Oat Hill NO 3 7,685% 29/5/2046	178.559	0,16
EUR 200.000	Banco Santander 3,625% 21/3/2029	141.650	0,13	GBP 391.000	Permanent Master Issuer 5,652% 15/7/2073	496.619	0,45
GBP 500.000	CaixaBank 1,5% 3/12/2026	561.653	0,50	GBP 100.000	Polaris 2023-1 9,547% 23/2/2061	126.423	0,11
EUR 100.000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	94.491	0,08	USD 140.000	Royalty Pharma 2,2% 2/9/2030	111.753	0,10
EUR 100.000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	85.440	0,08	GBP 300.000	Santander UK 7,098% 16/11/2027*	381.342	0,34
EUR 100.000	Cellnex Telecom 0,75% 20/11/2031	83.451	0,08	USD 400.000	Standard Chartered 7,767% 16/11/2028	424.522	0,38
GBP 300.000	Iberdrola Finanzas 7,375% 29/1/2024	382.410	0,34	GBP 500.000	Tower Bridge Funding 2023-2 6,108% 20/3/2065	634.223	0,57
		1.883.186	1,69	USD 276.000	Vmed O2 UK Financing I 4,25% 31/1/2031*	225.955	0,20
				USD 290.000	Vmed O2 UK Financing I 4,75% 15/7/2031	241.603	0,22
	Suède			EUR 104.000	Vodafone 2,625% 27/8/2080	103.119	0,09
EUR 100.000	Heimstaden Bostad 2,625% 1/2/2027	47.103	0,04			6.370.822	5,71
					États-Unis		
				USD 55.000	AbbVie 3,75% 14/11/2023	54.777	0,05
				USD 160.000	AbbVie 4,875% 14/11/2048	147.970	0,13
				USD 144.000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	133.009	0,12
				USD 24.000	Acadia Healthcare 5,5% 1/7/2028	22.703	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 90.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,5% 15/3/2029	78.044	0,07	USD 500.000	Broadcom 4,15% 15/4/2032	447.972	0,40
USD 67.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,625% 15/1/2027	63.437	0,06	USD 125.000	Broadcom 4,3% 15/11/2032	113.072	0,10
USD 222.000	Alexandria Real Estate Equities 2% 18/5/2032	168.354	0,15	USD 400.000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 4,058% 10/3/2033	339.153	0,31
USD 29.000	Allegiant Travel 7,25% 15/8/2027	28.414	0,03	USD 184.000	Calpine 4,5% 15/2/2028	170.819	0,15
USD 232.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6,625% 15/7/2026	221.116	0,20	USD 41.000	Calpine 5,125% 15/3/2028	37.494	0,03
USD 225.000	American Tower 2,7% 15/4/2031	184.071	0,17	EUR 100.000	Catalent Pharma Solutions 2,375% 1/3/2028	90.870	0,08
USD 250.000	American Tower 4,05% 15/3/2032	223.045	0,20	USD 202.000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	186.330	0,17
USD 175.000	American Water Capital 4,45% 1/6/2032	166.102	0,15	USD 197.000	CCO / CCO Capital 5,125% 1/5/2027	185.842	0,17
USD 122.000	Amgen 2,77% 1/9/2053	73.114	0,07	USD 81.000	CCO / CCO Capital 5,375% 1/6/2029	74.042	0,07
USD 85.000	Amgen 3% 15/1/2052	55.484	0,05	USD 73.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,5% 1/5/2025	72.520	0,07
USD 175.000	Amgen 5,15% 2/3/2028	174.696	0,16	USD 300.000	CenterPoint Energy Houston Electric 4,95% 1/4/2033	295.197	0,27
USD 250.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 8,2% 15/1/2039	318.931	0,29	USD 38.000	CenterPoint Energy Houston Electric 5,3% 1/4/2053	37.845	0,03
EUR 100.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028*	90.116	0,08	USD 93.000	Century Communities 3,875% 15/8/2029	80.205	0,07
USD 65.000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 8,583% 15/4/2035	63.223	0,06	USD 244.000	Century Communities 6,75% 1/6/2027	243.352	0,22
USD 163.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	140.563	0,13	USD 13.000	Charles River Laboratories International 4,25% 1/5/2028	11.931	0,01
USD 250.000	AT&T 4,3% 15/12/2042	202.664	0,18	USD 93.000	Citigroup 2,014% 25/1/2026	87.976	0,08
USD 250.000	AvalonBay Communities 2,05% 15/1/2032	200.510	0,18	USD 200.000	Citigroup 4,412% 31/3/2031	185.678	0,17
USD 8.000	Bank of America 1,922% 24/10/2031	6.271	0,01	USD 215.000	Citigroup 6,27% 17/11/2033	224.129	0,20
USD 535.000	Bank of America 2,572% 20/10/2032	428.775	0,38	USD 656.642	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 5,629% 25/5/2037	425.148	0,38
USD 113.000	Bank of America 5,202% 25/4/2029	111.295	0,10	USD 210.000	City of Boston MA 5% 1/11/2037	237.765	0,21
USD 355.000	Bank of New York Mellon 4,289% 13/6/2033	326.657	0,29	USD 11.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,25% 15/5/2026	10.900	0,01
USD 570.000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7,07% 10/2/2022***	143.001	0,13	USD 332.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	296.961	0,27
USD 340.103	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 6,129% 25/11/2035	310.358	0,28	USD 175.000	Comcast 4,65% 15/2/2033	171.115	0,15
USD 270.647	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5,769% 25/10/2036	251.944	0,23	USD 163.924	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 3,505% 10/8/2048	158.125	0,14
USD 369.377	Bayview Commercial Asset Trust 2006-SP2 5,849% 25/1/2037	345.989	0,31	USD 120.000	Commercial Metals 4,125% 15/1/2030	106.330	0,10
USD 319.964	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 5,834% 25/3/2037	287.937	0,26	USD 75.000	Commercial Metals 4,375% 15/3/2032	64.280	0,06
USD 279.777	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 6,435% 28/2/2040	245.151	0,22	USD 389.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	334.919	0,30
USD 277.524	BCAP 2012-RR3 Trust 4,667% 26/12/2037	230.830	0,21	USD 8.000	Crown Castle 2,5% 15/7/2031	6.458	0,01
USD 652.324	BCAP Trust 2007-AA4 4,244% 25/6/2047	297.765	0,27	USD 263.000	Crown Castle 2,9% 15/3/2027	241.270	0,22
USD 180.000	Becton Dickinson 4,298% 22/8/2032	168.335	0,15	USD 145.000	CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust 3,708% 15/11/2048	116.803	0,11
EUR 100.000	Belden 3,375% 15/7/2027	101.388	0,09	USD 140.000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4,864% 15/8/2051	111.521	0,10
USD 8.000	Broadcom 2,45% 15/2/2031	6.453	0,01	USD 200.000	CSC 5,375% 1/2/2028	163.890	0,15
				USD 182.000	CVS Health 2,7% 21/8/2040	122.399	0,11
				USD 175.000	CVS Health 5,25% 21/2/2033	171.484	0,15
				USD 79.000	Dana 5,375% 15/11/2027	74.835	0,07
				USD 85.000	Dana 5,625% 15/6/2028	80.092	0,07
				USD 8.000	Dave & Buster's 7,625% 1/11/2025	8.064	0,01
				USD 12.000	Dell International / EMC 3,45% 15/12/2051	7.877	0,01
				USD 500.000	Dell International / EMC 6,2% 15/7/2030	514.657	0,46
				USD 19.000	Dell International / EMC 8,35% 15/7/2046	23.319	0,02
				USD 156.000	Dominion Energy 2,25% 15/8/2031	124.387	0,11
				USD 160.000	DTE Electric 3,25% 1/4/2051	112.079	0,10

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 21.000	Elanco Animal Health 6,65% 28/8/2028	20.764	0,02	USD 56.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow / Hilton Grand Vacations Borrower Esc 5% 1/6/2029	49.726	0,04
USD 250.000	Elevance Health 6,1% 15/10/2052	266.154	0,24	USD 224.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	202.289	0,18
EUR 100.000	Encore Capital 4,875% 15/10/2025*	103.764	0,09	USD 350.000	HP 2,65% 17/6/2031	283.563	0,25
USD 360.000	Equinix 1,55% 15/3/2028	303.879	0,27	USD 119.000	iHeartCommunications 4,75% 15/1/2028	91.875	0,08
USD 1.443.761	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2050	1.348.763	1,21	USD 164.000	iHeartCommunications 5,25% 15/8/2027	130.294	0,12
USD 152.000	Five Point Operating / Five Point Capital 7,875% 15/11/2025*	142.599	0,13	USD 192.179	iHeartCommunications 6,375% 1/5/2026	167.720	0,15
USD 135.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032	105.586	0,09	USD 130.000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3,911% 10/7/2035	121.036	0,11
USD 99.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	94.490	0,08	USD 454.845	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 5,669% 25/8/2037	400.085	0,36
GBP 100.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	121.235	0,11	USD 12.000	International Business Machines 2,95% 15/5/2050	7.728	0,01
EUR 300.000	Ford Motor Credit 4,867% 3/8/2027	321.249	0,29	USD 102.000	Iron Mountain 5% 15/7/2028	94.337	0,08
USD 200.000	Ford Motor Credit 5,584% 18/3/2024	199.038	0,18	USD 177.000	Iron Mountain 5,25% 15/3/2028	166.597	0,15
EUR 100.000	Ford Motor Credit 6,125% 15/5/2028	111.410	0,10	USD 155.887	JP Morgan Mortgage Trust 2017-5 3,47% 26/10/2048	152.937	0,14
USD 75.000	Forestar 3,85% 15/5/2026	69.599	0,06	USD 75.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 4,29% 15/12/2048	56.687	0,05
USD 81.000	Forestar 5% 1/3/2028	75.006	0,07	USD 505.000	JPMorgan Chase 1,47% 22/9/2027	446.275	0,40
USD 2.670.896	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0,941% 25/5/2029	91.952	0,08	USD 8.000	JPMorgan Chase 1,764% 19/11/2031	6.263	0,01
USD 43.000	Freedom Mortgage 8,25% 15/4/2025	42.366	0,04	USD 175.000	JPMorgan Chase 4,912% 25/7/2033	168.350	0,15
USD 125.000	FREMF 2018-KW05 Trust 3,786% 25/4/2028	105.195	0,10	USD 136.000	KB Home 4,8% 15/11/2029	123.253	0,11
USD 20.935.758	FREMF 2019-KW08 Mortgage Trust 0,1% 25/1/2029	77.459	0,07	USD 773.000	Kilroy Realty 2,5% 15/11/2032	543.934	0,49
USD 115.000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7,894% 17/8/2037	115.575	0,10	USD 245.000	Kraft Heinz Foods 3,75% 1/4/2030	224.562	0,20
USD 186.000	General Motors 5,4% 15/10/2029	179.589	0,16	USD 14.000	Lamar Media 3,75% 15/2/2028	12.751	0,01
GBP 500.000	General Motors Financial 2,25% 6/9/2024	609.092	0,55	EUR 100.000	Liberty Mutual 3,625% 23/5/2059	103.562	0,09
USD 200.000	General Motors Financial 2,35% 8/1/2031	155.460	0,14	USD 136.076	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-1 6,029% 25/2/2036	111.028	0,10
USD 170.000	General Motors Financial 6,05% 10/10/2025	170.127	0,15	USD 12.000	Lowe's 3% 15/10/2050	7.629	0,01
USD 330.000	Global Payments 2,9% 15/5/2030	278.995	0,25	USD 125.000	Lowe's 4,25% 1/4/2052	99.069	0,09
USD 200.000	Goldman Sachs 1,431% 9/3/2027	179.299	0,16	USD 300.000	LYB International Finance III 3,375% 1/10/2040	215.578	0,19
USD 220.000	Goldman Sachs 1,542% 10/9/2027	194.162	0,17	USD 250.000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4,108% 15/8/2034	212.188	0,19
USD 8.000	Goldman Sachs 2,383% 21/7/2032	6.325	0,01	USD 58.000	Marriott Ownership Resorts 4,5% 15/6/2029	49.064	0,04
USD 345.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	279.436	0,25	USD 190.000	Marriott Ownership Resorts 4,75% 15/1/2028	170.753	0,15
USD 20.000	Goldman Sachs 2,908% 21/7/2042	13.840	0,01	USD 35.000	Marsh & McLennan 2,375% 15/12/2031	28.500	0,03
GBP 200.000	Goldman Sachs 7,25% 10/4/2028	263.784	0,24	USD 334.246	Mastr Resecuritization Trust 2008-1 6% 27/9/2037	289.326	0,26
USD 679.000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 8,804% 25/2/2047	610.617	0,55	USD 82.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	80.658	0,07
USD 200.000	HCA 2,375% 15/7/2031	157.893	0,14	USD 265.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	230.939	0,21
USD 265.000	HCA 3,5% 1/9/2030	231.599	0,21	USD 9.000	Moody's 3,1% 29/11/2061	5.715	0,01
USD 49.000	HCA 5,375% 1/2/2025	48.678	0,04	USD 8.000	Morgan Stanley 1,794% 13/2/2032	6.159	0,01
USD 225.000	HCA 5,875% 1/2/2029	226.177	0,20	EUR 200.000	Morgan Stanley 2,103% 8/5/2026*	208.950	0,19
USD 108.000	Healthpeak 2,125% 1/12/2028	92.214	0,08	USD 68.000	Morgan Stanley 2,475% 21/1/2028	61.334	0,05
USD 285.000	Healthpeak 5,25% 15/12/2032	275.221	0,25	USD 175.000	Morgan Stanley 2,699% 22/1/2031	147.314	0,13
USD 87.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow / Hilton Grand Vacations Borrower Esc 4,875% 1/7/2031	73.421	0,07				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 245.000	Morgan Stanley 3,62% 17/4/2025	241.240	0,22	USD 249.645	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7,867% 25/10/2039	249.819	0,22
USD 145.000	Morgan Stanley 6,342% 18/10/2033	152.154	0,14	USD 21.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	19.498	0,02
USD 25.000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2,73% 15/12/2050	15.219	0,01	USD 93.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	82.747	0,07
USD 76.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 4,281% 15/6/2050	60.270	0,05	USD 138.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,625% 1/3/2029	117.740	0,11
USD 140.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	120.850	0,11	USD 19.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,875% 1/3/2031	15.412	0,01
USD 107.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	72.514	0,07	USD 500.000	RR 1 7,17% 15/7/2035	494.405	0,44
USD 170.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 8,23% 15/7/2035	167.121	0,15	USD 125.000	Ryder System 2,9% 1/12/2026	115.088	0,10
USD 412.251	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 5,97% 22/2/2044	344.925	0,31	USD 200.000	Sasol Financing USA 6,5% 27/9/2028*	181.551	0,16
USD 400.000	Motorola Solutions 2,3% 15/11/2030	318.920	0,29	USD 435.016	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 1,151% 25/8/2057	68.356	0,06
USD 173.636	MSCG Trust 2018-SELF 7,508% 15/10/2037	169.981	0,15	USD 79.000	Sempra 3,7% 1/4/2029	72.086	0,06
USD 148.272	Multi Security Asset Trust Commercial Mortgage-Backed Pass-Through 4,78% 28/11/2035	99.620	0,09	USD 250.000	Sherwin-Williams 2,9% 15/3/2052	157.418	0,14
USD 57.000	Nationstar Mortgage 5,5% 15/8/2028	51.863	0,05	USD 250.000	Sherwin-Williams 4,05% 8/8/2024	246.019	0,22
USD 3.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	2.860	0,00	USD 27.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	24.932	0,02
USD 800.000	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-SOX 4,932% 17/6/2038	661.836	0,59	USD 23.000	Sirius XM Radio 5,5% 1/7/2029	20.747	0,02
USD 300.000	Netflix 4,875% 15/4/2028	295.301	0,26	USD 169.284	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3,86% 15/1/2053	153.231	0,14
USD 108.000	Nexstar Media 5,625% 15/7/2027	101.635	0,09	USD 88.672	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3,86% 15/1/2053	79.698	0,07
USD 200.000	NextEra Energy Capital 5,25% 28/2/2053	185.554	0,17	USD 275.000	Southern California Edison 3,65% 1/6/2051	196.730	0,18
USD 88.000	Northern States Power 3,2% 1/4/2052	59.981	0,05	USD 290.000	Sprint 7,875% 15/9/2023	289.807	0,26
USD 67.000	Oncor Electric Delivery 4,15% 1/6/2032	62.805	0,06	USD 24.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	22.125	0,02
USD 500.000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3,14% 14/10/2036	458.897	0,41	USD 13.000	Standard Industries 5% 15/2/2027	12.368	0,01
USD 12.000	OPENLANE 5,125% 1/6/2025	11.607	0,01	USD 150.000	Steel Dynamics 3,25% 15/10/2050	96.958	0,09
USD 200.000	Oracle 2,95% 1/4/2030	173.265	0,15	USD 125.000	Steel Dynamics 3,45% 15/4/2030	110.968	0,10
USD 205.000	Oracle 4% 15/7/2046	154.041	0,14	USD 7.000	Stem 0,5% 1/12/2028	4.274	0,00
USD 67.000	Oracle 5,55% 6/2/2053	62.478	0,06	USD 125.000	Target 3,375% 15/4/2029	116.811	0,11
USD 13.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	10.579	0,01	USD 111.000	Taylor Morrison Communities 5,125% 1/8/2030	101.973	0,09
USD 19.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	17.215	0,02	USD 222.000	Taylor Morrison Communities 5,75% 15/1/2028	214.330	0,19
USD 22.000	Owens-Brockway Glass Container 7,25% 15/5/2031	22.120	0,02	USD 266.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	261.624	0,24
USD 18.000	Park Intermediate / PK Domestic Property / PK Finance Co-Issuer 4,875% 15/5/2029	15.631	0,01	USD 74.000	TEGNA 4,625% 15/3/2028	66.454	0,06
USD 175.000	PECO Energy 4,6% 15/5/2052	153.849	0,14	USD 21.000	TEGNA 5% 15/9/2029	18.537	0,02
USD 24.000	Playtika 4,25% 15/3/2029	20.751	0,02	USD 17.000	Teleflex 4,625% 15/11/2027	15.960	0,01
USD 156.000	PNC Financial Services 4,758% 26/1/2027	153.062	0,14	USD 650.000	T-Mobile USA 2,875% 15/2/2031	546.307	0,49
USD 439.000	Prologis 1,75% 1/2/2031	346.970	0,31	USD 29.000	Travel + Leisure 4,625% 1/3/2030	24.980	0,02
USD 8.000	Prologis 2,25% 15/1/2032	6.425	0,01	USD 97.000	Travel + Leisure 6% 1/4/2027	93.686	0,08
USD 235.000	Prologis 4,625% 15/1/2033	225.565	0,20	USD 186.000	Travel + Leisure 6,625% 31/7/2026	183.559	0,16
USD 350.000	Public Service Electric and Gas 4,65% 15/3/2033	339.409	0,31	USD 128.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	122.046	0,11
USD 200.000	QUALCOMM 6% 20/5/2053	215.777	0,19	USD 500.000	Tricon American Homes 2017-SFR2 Trust 5,104% 17/1/2036	494.568	0,45
USD 413.222	RALI Series 2006-QO5 Trust 5,809% 25/5/2046	382.961	0,34	USD 510.000	UDR 1,9% 15/3/2033	373.521	0,34
				USD 200.000	Union Pacific 4,95% 9/9/2052	193.907	0,18
				USD 3.370.000	United States Treasury Bill 0% 16/11/2023	3.332.418	2,99
				USD 264.000	United Wholesale Mortgage 5,5% 15/11/2025	253.783	0,23
				USD 141.000	United Wholesale Mortgage 5,5% 15/4/2029	122.459	0,11
				USD 174.000	United Wholesale Mortgage 5,75% 15/6/2027	161.123	0,14
				USD 250.000	UnitedHealth 6,05% 15/2/2063	272.943	0,24

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
COP	243.528.000	USD	55.486	BNP Paribas	17/5/2024	596
COP	195.180.000	USD	47.135	Citigroup	14/9/2023	239
COP	195.767.000	USD	47.115	BNP Paribas	29/9/2023	163
CZK	1.163.306	USD	52.664	Barclays	14/9/2023	(220)
CZK	2.515.040	USD	117.514	UBS	14/9/2023	(4.131)
CZK	2.569.192	USD	117.921	Morgan Stanley	14/9/2023	(2.096)
EUR	111.000	USD	123.322	Barclays	14/9/2023	(2.834)
EUR	924.000	USD	1.009.461	Morgan Stanley	20/9/2023	(6.195)
HUF	34.465.000	USD	97.748	JP Morgan	14/9/2023	373
HUF	23.972.075	USD	69.362	Barclays	14/9/2023	(1.114)
HUF	12.486.000	USD	35.362	Citigroup	14/9/2023	185
IDR	1.797.940.000	USD	119.943	JP Morgan	14/9/2023	(1.904)
IDR	1.321.038.452	USD	86.348	HSBC Bank	14/9/2023	381
INR	24.082.000	USD	290.717	Citigroup	14/9/2023	170
INR	4.887.000	USD	59.172	BNP Paribas	14/9/2023	(142)
KRW	85.065.000	USD	65.216	Citigroup	14/9/2023	(852)
MXN	1.867.175	USD	106.900	Barclays	20/9/2023	4.360
MXN	3.740.680	USD	219.000	JP Morgan	20/9/2023	3.898
MXN	3.200	USD	186	Morgan Stanley	14/9/2023	5
MYR	221.989	USD	49.167	Barclays	14/9/2023	(1.290)
NOK	700.148	USD	65.119	HSBC Bank	14/9/2023	650
PLN	370.000	USD	88.782	Bank of America	14/9/2023	994
SGD	93.709	USD	69.794	Barclays	14/9/2023	(436)
THB	5.206.390	USD	150.735	HSBC Bank	14/9/2023	(1.908)
THB	4.300.000	USD	124.704	Citigroup	14/9/2023	(1.786)
USD	124.121	IDR	1.847.643.974	UBS	14/9/2023	2.820
USD	80.312	CZK	1.780.417	UBS	14/9/2023	47
USD	492.919	MXN	8.716.730	JP Morgan	14/9/2023	(27.031)
USD	129.680	ZAR	2.502.849	Goldman Sachs	14/9/2023	(3.404)
USD	241.247	COP	1.019.847.267	Citigroup	14/9/2023	(6.288)
USD	449.559	EUR	414.830	JP Morgan	14/9/2023	(728)
USD	203.268	EUR	187.000	JP Morgan	20/9/2023	227
USD	169.000	BRL	832.883	Morgan Stanley	20/9/2023	390
USD	54.000	MXN	943.012	JP Morgan	20/9/2023	(2.192)
USD	160.000	CNH	1.136.101	Barclays	20/9/2023	3.713
USD	326.940	EUR	300.000	HSBC Bank	20/9/2023	1.205
USD	41.644	CZK	911.164	Goldman Sachs	14/9/2023	567
USD	119.539	BRL	584.766	Citigroup	14/9/2023	1.043
USD	171.305	ZAR	3.276.497	Morgan Stanley	14/9/2023	(2.915)
USD	109.000	BRL	531.885	Goldman Sachs	20/9/2023	1.324
USD	109.000	MXN	1.898.747	Goldman Sachs	20/9/2023	(4.142)
USD	8.884	JPY	1.239.000	BNY Mellon	20/9/2023	384
USD	297.142	EUR	270.000	Bank of America	20/9/2023	3.979
USD	11.725.348	EUR	10.682.000	BNP Paribas	20/9/2023	126.982
USD	5.725.425	GBP	4.465.000	BNP Paribas	20/9/2023	64.956
USD	1.129.888	GBP	874.000	JP Morgan	20/9/2023	21.880
USD	84.348	ZAR	1.577.006	Citigroup	14/9/2023	494
USD	32.846	THB	1.151.085	Barclays	14/9/2023	(58)
USD	37.314	MXN	647.879	Goldman Sachs	14/9/2023	(1.332)
USD	107.206	IDR	1.625.456.309	Citigroup	14/9/2023	492
USD	69.434	SGD	93.709	Goldman Sachs	14/9/2023	77
USD	268.843	INR	22.115.000	Barclays	14/9/2023	1.715
USD	109.000	MXN	1.902.620	Barclays	20/9/2023	(4.372)
USD	109.000	BRL	545.073	Citigroup	20/9/2023	(1.346)
USD	267.030	GBP	209.000	BNY Mellon	20/9/2023	2.072
USD	521.941	EUR	466.000	Citigroup	20/9/2023	15.965
USD	69.506	NOK	700.148	Barclays	14/9/2023	3.737
USD	107.135	EUR	96.000	UBS	20/9/2023	2.900

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	1.601.295	GBP	1.260.000	Morgan Stanley	20/9/2023	3.940
USD	204.187	CZK	4.484.642	Barclays	14/9/2023	2.010
USD	72.336	HUF	25.340.000	JP Morgan	14/9/2023	193
USD	234.666	BRL	1.149.005	BNY Mellon	14/9/2023	1.831
USD	129.669	GBP	100.000	UBS	20/9/2023	2.894
USD	95.943	MXN	1.663.500	Citigroup	14/9/2023	(3.285)
USD	82.450	PLN	337.000	JP Morgan	14/9/2023	681
USD	54.226	BRL	265.000	Goldman Sachs	14/9/2023	526
USD	117.930	MXN	2.013.556	Barclays	14/9/2023	(2.178)
USD	107.310	CNH	778.000	Citigroup	14/9/2023	319
USD	55.017	CNH	400.000	Morgan Stanley	14/9/2023	9
USD	58.274	COP	243.528.000	BNP Paribas	17/10/2023	(242)
USD	35.590	THB	1.261.000	BNP Paribas	14/9/2023	(456)
USD	73.621	EUR	68.000	BNY Mellon	20/9/2023	(212)
USD	77.130	AUD	119.000	Barclays	20/9/2023	2
USD	513.786	EUR	470.000	Barclays	20/9/2023	3.467
USD	117.413	COP	481.547.093	BNY Mellon	14/9/2023	533
ZAR	2.006.041	USD	110.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(3.389)
ZAR	1.098.000	USD	60.954	HSBC Bank	14/9/2023	(2.570)
ZAR	2.040.000	USD	108.114	Citigroup	14/9/2023	359
Plus-value nette non réalisée						193.423
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	1.048.941	USD	683.170	BNY Mellon	15/9/2023	(3.441)
USD	3.508	AUD	5.480	BNY Mellon	15/9/2023	(43)
Moins-value nette non réalisée						(3.484)
Catégorie d'Actions couverte en BRL						
BRL	83.324.243	USD	16.780.863	BNY Mellon	15/9/2023	101.385
USD	45.000	BRL	221.069	BNY Mellon	15/9/2023	210
Plus-value nette non réalisée						101.595
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	5.520	USD	4.105	BNY Mellon	15/9/2023	(24)
USD	23	CAD	31	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(24)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	342.556	USD	392.251	BNY Mellon	15/9/2023	(3.929)
USD	4.106	CHF	3.604	BNY Mellon	15/9/2023	22
Moins-value nette non réalisée						(3.907)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	28.857	USD	3.999	BNY Mellon	15/9/2023	(31)
USD	28	CNY	201	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(31)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	35.432.976	USD	38.874.624	BNY Mellon	15/9/2023	(411.090)
USD	355.131	EUR	326.463	BNY Mellon	15/9/2023	750
Moins-value nette non réalisée						(410.340)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	443.708	USD	564.572	BNY Mellon	15/9/2023	(2.079)
USD	3.307	GBP	2.598	BNY Mellon	15/9/2023	14
Moins-value nette non réalisée						(2.065)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	32.334	USD	4.143	BNY Mellon	15/9/2023	(18)
USD	24	HKD	189	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(18)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	115.820	USD	69.974	BNY Mellon	15/9/2023	(1.088)
USD	363	NZD	612	BNY Mellon	15/9/2023	(1)
Moins-value nette non réalisée						(1.089)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	254.592	USD	189.139	BNY Mellon	15/9/2023	(697)
USD	2.386	SGD	3.237	BNY Mellon	15/9/2023	(10)
Moins-value nette non réalisée						(707)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 89.518.863)						(126.647)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(18)	EUR	Euro BOBL	Septembre 2023	2.265.951	12.303
18	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	2.597.359	(13.562)
(1)	EUR	Euro BUXL	Septembre 2023	144.797	2.734
(4)	EUR	Euro Schatz	Septembre 2023	456.089	1.606
4	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	554.233	(4.297)
2	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	94.108	(206)
1	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	49.265	(1.800)
1	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	Septembre 2023	311.330	11.631
(5)	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	1.133.937	(19.870)
3	EUR	EURO STOXX Banks Index	Septembre 2023	18.333	1.408
(3)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	364.687	(5.224)
(41)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	4.546.516	(33.078)
(106)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	12.294.344	(151.947)
(31)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	4.013.531	(55.050)
7	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	845.916	9.850
75	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	15.275.391	34.085
33	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	3.524.555	20.245
Total				48.490.342	(191.172)

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD (250.000)	Fund provides default protection on CDX.NA.IG.33.V1; and receives Fixed 1%	Credit Suisse	20/12/2024	(1.802)	2.308
CDS	USD 880.000	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.33.V12; and pays Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2024	3.409	(22.365)
CDS	EUR (310.000)	Fund provides default protection on ITRAXX.XO.38.V1; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2027	27.756	16.541
CDS	USD (393.000)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2028	11.196	11.628
CDS	EUR (40.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2027	1.087	4.731
IRS	BRL 979.000	Fund receives Fixed 9,98%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2026	(493)	(493)
IRS	BRL 159.327	Fund receives Fixed 11,5625%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	851	851
IRS	BRL 248.416	Fund receives Fixed 11,82%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	1.655	1.655
IRS	BRL 1.753.000	Fund receives Fixed 10,3164%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	4/1/2027	834	834

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	BRL 220.267	Fund receives Fixed 11,27%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	2/1/2026	892	892
IRS	BRL 31.446	Fund receives Fixed 13,125%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	202	202
IRS	BRL 654.839	Fund receives Fixed 13,15%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	4.261	4.261
IRS	BRL 653.416	Fund receives Fixed 13,32%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	4.670	4.670
IRS	BRL 879.706	Fund receives Fixed 9,965%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(1.603)	(1.603)
IRS	BRL 3.880.139	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(132)	(132)
IRS	BRL 179.743	Fund receives Fixed 13,22%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2025	1.217	1.217
IRS	BRL 90.904	Fund receives Fixed 11,76%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	576	576
IRS	BRL 856.329	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	4/1/2027	(1.640)	(1.640)
IRS	USD 2.342.200	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 4,18%	Credit Suisse	21/6/2024	29.625	23.866
IRS	USD 5.574.193	Fund receives Fixed 5,3715%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Credit Suisse	12/7/2024	(4.269)	(4.269)
IRS	USD 5.574.193	Fund receives Fixed 5,3745%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Credit Suisse	12/7/2024	(4.131)	(4.131)
IRS	MXN 1.230.205	Fund receives Fixed 9,8%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Credit Suisse	4/2/2025	(732)	(732)
IRS	MXN 4.621.962	Fund receives Fixed 9,9%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Credit Suisse	5/2/2025	(2.377)	(2.377)
IRS	MXN 2.227.015	Fund receives Fixed 9,92%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Credit Suisse	5/2/2025	(1.109)	(1.109)
IRS	MXN 25.564.000	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Credit Suisse	7/2/2025	(12.043)	(12.043)
IRS	MXN 40.092.000	Fund receives Fixed 9,6%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Credit Suisse	15/7/2025	(24.466)	(24.466)
IRS	ZAR 3.625.131	Fund receives Floating ZAR JIBAR 3 Month; and pays Fixed 8,22%	Credit Suisse	20/9/2026	(1.624)	(1.624)
IRS	USD 610.000	Fund receives Fixed 3,468%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Credit Suisse	10/3/2027	(1.799)	(1.799)
IRS	MXN 6.312.000	Fund receives Fixed 9,1343%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Credit Suisse	15/8/2028	3.181	3.181
IRS	USD 466.300	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,5%	Credit Suisse	27/5/2031	20.479	11.802
IRS	USD 82.900	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,5%	Credit Suisse	28/5/2031	3.641	2.098
IRS	USD 369.600	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,5%	Credit Suisse	12/10/2031	16.684	9.386
IRS	USD 1.155.700	Fund receives Fixed 3,5%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Credit Suisse	19/11/2031	(50.467)	(29.497)
IRS	USD 293.339	Fund receives Fixed 3,415%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Credit Suisse	5/10/2032	(9.544)	(9.544)
IRS	USD 665.000	Fund receives Fixed 3,191%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Credit Suisse	28/11/2032	(33.291)	(33.291)
IRS	USD 1.340.329	Fund receives Fixed 3,136%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Credit Suisse	12/5/2033	(20.803)	(20.803)
IRS	MXN 10.363.000	Fund receives Fixed 8,04%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Credit Suisse	5/7/2033	(29.744)	(29.744)
IRS	USD 223.800	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,22%	Credit Suisse	27/5/2051	25.760	13.921
IRS	USD 36.800	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,22%	Credit Suisse	28/5/2051	4.236	2.289
IRS	COP 391.534.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 10,2%	Goldman Sachs	28/2/2025	34	34
IRS	BRL 1.050.000	Fund receives Fixed 10,1075%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	2/1/2026	8	8
IRS	BRL 852.185	Fund receives Fixed 10,005%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(1.760)	(1.760)
IRS	KRW 193.343.000	Fund receives Fixed 3,376%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	HSBC Bank	20/9/2026	(1.133)	(1.133)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	KRW 193.343.000	Fund receives Fixed 3,384%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	HSBC Bank	20/9/2026	(1.100)	(1.100)
IRS	KRW 193.314.000	Fund receives Fixed 3,389%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	HSBC Bank	20/9/2026	(1.079)	(1.079)
IRS	BRL 341.681	Fund receives Fixed 13,18%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2025	2.262	2.262
IRS	BRL 94.911	Fund receives Fixed 11,775%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2026	609	609
IRS	BRL 854.357	Fund receives Fixed 10,025%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	(1.237)	(1.237)
IRS	BRL 15.000.000	Fund receives Fixed 10,82%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2025	2.611	2.611
IRS	BRL 6.859.205	Fund receives Fixed 12,7825%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2025	35.244	35.244
IRS	BRL 166.907	Fund receives Fixed 11,83%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2026	1.121	1.121
IRS	BRL 855.276	Fund receives Fixed 9,99%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	4/1/2027	(1.425)	(1.425)
IRS	BRL 5.000.000	Fund receives Fixed 10,395%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2029	(14.254)	(14.254)
IRS	USD 2.373.800	Fund receives Fixed 3,71%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	HSBC Bank	10/1/2027	(61.166)	(45.437)
TRS	USD 2.650.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	30.962	24.787
TRS	USD 210.000	Fund receives iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	JP Morgan	20/9/2023	(1.878)	(2.367)
TRS	USD 713	Fund receives JPM EMBIG DIV CORE + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 75bps	JP Morgan	20/9/2023	(3.663)	(3.663)
TRS	USD 595.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	JP Morgan	20/9/2023	6.966	5.565
TRS	USD 2.454.500	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	BNP Paribas	20/9/2023	30.242	24.251
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 43.484.332)					(18.493)	(61.716)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
8	Call	NASDAQ 100 Index	UBS	USD 15.700	15/9/2023	(361)	1.107
2	Call	Barclays	Exchange Traded	GBP 1,6	15/9/2023	(85)	6
2	Call	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(267)	5
3	Call	Ford Motor	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(154)	3
1	Call	General Motors	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(152)	3
2	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	(1.394)	87
1	Call	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(199)	26
1	Call	UniCredit	Exchange Traded	EUR 23	15/9/2023	(214)	191
1	Call	Apple	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	777	1.165
2	Call	Micron Technology	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	465	830
4	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 463	20/10/2023	160	1.510
1	Call	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/11/2023	26	428
4	Call	Kenvue	Exchange Traded	USD 25	17/11/2023	(79)	230
1	Call	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 140	17/11/2023	36	492
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 145.658)						(1.441)	6.083

Sustainable Global Bond Income Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(2)	Call	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	66	(2)
(3)	Put	Ford Motor	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(197)	(265)
(1)	Put	General Motors	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	(84)	(171)
(1)	Call	Microsoft	Exchange Traded	USD 380	15/9/2023	482	(6)
(2)	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	571	(25)
(1)	Put	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 42,5	15/9/2023	107	(14)
(1)	Put	UniCredit	Exchange Traded	EUR 20	15/9/2023	201	(21)
(1)	Put	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	176	(44)
(2)	Put	Micron Technology	Exchange Traded	USD 52,5	20/10/2023	137	(41)
(1)	Put	Amazon.com	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	68	(149)
(4)	Put	Kenvue	Exchange Traded	USD 20	17/11/2023	19	(70)
(1)	Put	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(30)	(130)
(1)	Call	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/12/2023	(1.721)	(4.153)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 50.951)						(205)	(5.091)

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (376.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 18/12/2024; and pays 2,4% Fixed semi-annually from 18/6/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	6.735	(108)
USD (376.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 18/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/12/2024	Morgan Stanley	14/12/2023	(2.886)	(10.218)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 229.449)				3.849	(10.326)

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 602.997	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	519.662	0,47
USD 7.343.883	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	6.561.070	5,89
USD 3.714.482	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	3.522.675	3,16
Total TBA (USD Exposition sous-jacente - USD 10.603.407)		10.603.407	9,52

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable Global Infrastructure Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Australie				Espagne			
20.682	NEXTDC	181.393	1,56	764	Aena SME	120.688	1,04
27.228	Transurban	233.866	2,01	14.107	Cellnex Telecom	543.951	4,67
		415.259	3,57	7.331	EDP Renovaveis*	135.054	1,16
				799.693 6,87			
				Suisse			
				555	Flughafen Zurich	115.247	0,99
				Émirats arabes unis			
Belgique				146.044	Salik	133.199	1,14
1.700	Aedifica	113.800	0,98	Royaume-Uni			
Canada				109.590	Helios Towers	125.516	1,08
10.842	Boralex	265.108	2,28	51.718	National Grid	654.030	5,62
2.881	Canadian Pacific Kansas City	229.738	1,97	3.812	Severn Trent*	116.930	1,00
6.840	Hydro One	183.784	1,58	45.058	Smart Metering Systems	388.025	3,33
		678.630	5,83	21.167	SSE	437.636	3,76
				20.116	United Utilities*	240.822	2,07
				1.962.959 16,86			
Îles Caïmans				États-Unis			
16.679	IHS	123.758	1,06	1.424	Alexandria Real Estate Equities	167.107	1,43
Danemark				2.144	American Tower	391.344	3,36
3.474	Orsted*	223.105	1,92	20.891	Clearway Energy	521.231	4,48
France				7.097	CSX	215.891	1,86
2.531	Aéroports de Paris	338.307	2,90	924	Digital Realty Trust	121.626	1,04
17.180	Getlink	288.630	2,48	383	Equinix	302.256	2,60
		626.937	5,38	3.561	Eversource Energy	230.005	1,97
Allemagne				7.979	Exelon	323.628	2,78
3.227	Fraport Frankfurt Airport Services Worldwide	174.006	1,49	11.917	Physicians Realty Trust	166.361	1,43
Italie				3.116	Portland General Electric	138.506	1,19
13.341	Enav	53.989	0,46	2.622	SBA Communications	596.780	5,13
74.665	Enel*	505.162	4,34	2.949	Xcel Energy	170.983	1,47
14.071	Infrastrutture Wireless Italiane	175.486	1,51	3.345.718 28,74			
70.706	Terna - Rete Elettrica Nazionale	586.541	5,04	Total des actions ordinaires 10.953.534 94,08			
		1.321.178	11,35	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé 10.953.534 94,08			
Japon				Total du portefeuille 10.953.534 94,08			
2.700	West Japan Railway	116.457	1,00	Autres éléments de l'actif net 688.914 5,92			
Portugal				Total de l'actif net (USD) 11.642.448 100,00			
125.614	EDP - Energias de Portugal	577.300	4,96				
82.766	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS	226.288	1,94				
		803.588	6,90				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Sustainable Global Infrastructure Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Services aux collectivités	47,56
Valeurs industrielles	25,84
Finance	15,97
Biens de consommation non cyclique	3,15
Communications	1,56
Autres éléments de l'actif net	5,92
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 950.000	CIFC Funding 2017-IV 7,157% 24/10/2030	943.162	0,10	USD 1.000.000	Voya CLO 2018-2 6,82% 15/7/2031	975.052	0,11
USD 340.000	Country Garden 3,3% 12/1/2031	27.200	0,00			37.951.630	4,10
USD 1.000.000	Eaton Vance CLO 2015-1 6,838% 20/1/2030	978.882	0,11		Chili		
USD 250.000	Eaton Vance CLO 2015-1 7,038% 20/1/2030	247.162	0,03	USD 200.000	Celulosa Arauco y Constitucion 4,2% 29/1/2030	177.506	0,02
USD 200.000	Fantasia 10,875% 9/1/2023***	10.000	0,00	USD 200.000	Chile Government International Bond 2,45% 31/1/2031*	170.447	0,02
USD 200.000	Fantasia 11,875% 1/6/2023***	10.000	0,00	USD 500.000	Chile Government International Bond 3,1% 7/5/2041*	363.738	0,04
USD 300.000	Fibria Overseas Finance 5,5% 17/1/2027	299.965	0,03	USD 200.000	Chile Government International Bond 3,125% 21/1/2026	191.439	0,02
USD 200.000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027*	197.796	0,02	USD 1.176.000	Chile Government International Bond 3,5% 25/1/2050*	852.006	0,09
USD 200.000	Gaci First Investment 5,25% 13/10/2032*	200.228	0,02	USD 500.000	Inversiones CMPC 4,375% 4/4/2027	475.443	0,05
USD 1.250.000	Galaxy XXII CLO 6,77% 16/4/2034	1.233.242	0,13	USD 200.000	Nacional del Cobre de Chile 4,25% 17/7/2042	160.104	0,02
USD 320.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 7,138% 20/10/2032	319.131	0,03			2.390.683	0,26
USD 1.000.000	KKR CLO 17 6,65% 15/4/2034	991.517	0,11		Chine		
USD 400.000	KSA Sukuk 3,628% 20/4/2027*	382.378	0,04	CNY 88.200.000	China Government Bond 1,99% 9/4/2025	12.068.168	1,30
USD 735.806	Madison Park Funding XXVI 6,831% 29/7/2030	733.896	0,08	CNY 61.000.000	China Government Bond 2,37% 20/1/2027	8.381.320	0,91
USD 400.000	MAF Sukuk 4,5% 3/11/2025	392.148	0,05	CNY 50.000.000	China Government Bond 2,5% 25/7/2027	6.893.721	0,74
USD 3.000.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 35 6,922% 19/1/2033	2.996.832	0,32	CNY 25.000.000	China Government Bond 2,62% 25/9/2029	3.447.359	0,37
USD 500.000	OCP CLO 2020-18 6,678% 20/7/2032	495.293	0,05	CNY 67.400.000	China Government Bond 2,68% 21/5/2030	9.320.250	1,01
USD 750.000	Octagon Investment Partners 18-R 6,53% 16/4/2031	746.506	0,08	CNY 10.000.000	China Government Bond 2,7% 3/11/2026	1.390.040	0,15
USD 600.000	OZLM VI 7,32% 17/4/2031	595.205	0,06	CNY 40.000.000	China Government Bond 2,75% 17/2/2032	5.532.248	0,60
USD 750.000	Palmer Square CLO 2018-2 6,67% 16/7/2031	748.566	0,08	CNY 60.000.000	China Government Bond 2,79% 15/12/2029	8.340.163	0,90
USD 320.000	Palmer Square CLO 2020-3 7,226% 15/11/2031	317.412	0,03	CNY 27.700.000	China Government Bond 2,8% 24/3/2029	3.861.236	0,42
USD 800.000	Peace Park CLO 6,718% 20/10/2034	796.866	0,09	CNY 21.800.000	China Government Bond 2,8% 15/11/2032	3.028.871	0,33
USD 250.000	Pikes Peak CLO 4 6,77% 15/7/2034	248.407	0,03	CNY 26.000.000	China Government Bond 2,85% 4/6/2027	3.631.440	0,39
USD 300.000	Regatta IX Funding 8,02% 17/4/2030	301.810	0,03	CNY 10.000.000	China Government Bond 2,89% 18/11/2031	1.400.531	0,15
USD 250.000	Regatta XVI Funding 9,47% 15/1/2033	249.500	0,03	CNY 35.500.000	China Government Bond 2,94% 17/10/2024	4.923.458	0,53
USD 585.000	Regatta XXI Funding 7,288% 20/10/2034	580.601	0,06	CNY 28.350.000	China Government Bond 3,39% 16/3/2050	4.214.655	0,46
USD 483.828	Rockford Tower CLO 2018-1 6,741% 20/5/2031	482.256	0,05	CNY 1.900.000	China Government Bond 3,4% 15/7/2072	288.668	0,03
USD 685.000	RR 5 7,22% 15/10/2031	678.993	0,07	CNY 1.400.000	China Government Bond 3,72% 12/4/2051	220.883	0,02
USD 200.000	Saudi Electricity Sukuk Programme 4,632% 11/4/2033	195.352	0,02	CNY 2.950.000	China Government Bond 3,73% 25/5/2070	480.322	0,05
USD 250.000	Symphony CLO XXIV 6,807% 23/1/2032	249.065	0,03	CNY 2.000.000	China Government Bond 3,74% 22/9/2035	304.363	0,03
USD 500.000	TIAA CLO IV 6,818% 20/1/2032	498.204	0,05	CNY 1.500.000	China Government Bond 3,81% 14/9/2050	239.486	0,03
USD 452.113	TICP CLO IX 6,728% 20/1/2031	450.997	0,05	CNY 8.800.000	China Government Bond 3,97% 23/7/2048	1.429.928	0,15
GBP 200.000	Trafford Centre Finance 6,128% 28/7/2035	181.274	0,02	CNY 3.000.000	China Government Bond 4% 24/6/2069	515.126	0,06
USD 1.750.000	Trinitas CLO XIV 7,613% 25/1/2034	1.729.891	0,19	CNY 4.800.000	China Government Bond 4,03% 21/6/2040	771.803	0,08
USD 2.000.000	Trinitas CLO XIV 8,613% 25/1/2034	1.995.891	0,22	CNY 2.300.000	China Government Bond 4,05% 24/7/2047	376.671	0,04
USD 835.000	Voya CLO 2014-4 7,173% 14/7/2031	826.189	0,09				
USD 279.675	Voya CLO 2018-1 6,532% 19/4/2031	278.766	0,03				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
CNY 6.000.000	China Government Bond 4,08% 22/10/2048	988.699	0,11	EUR 650.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat 3,6% 8/3/2024	704.393	0,08
CNY 3.000.000	China Government Bond 4,5% 23/6/2041	512.296	0,06	EUR 300.000	Caisse Francaise de Financement Local 1% 25/4/2028	292.489	0,03
USD 200.000	Industrial & Commercial Bank of China 1,625% 28/10/2026	179.370	0,02	EUR 400.000	Caisse Francaise de Financement Local 1,125% 19/1/2033	355.642	0,04
		82.741.075	8,94	EUR 500.000	Cie de Financement Foncier 0,325% 12/9/2023	542.055	0,06
	Colombie			EUR 1.400.000	Cie de Financement Foncier 0,875% 11/9/2028	1.346.510	0,15
USD 800.000	Colombia Government International Bond 3,875% 25/4/2027	738.288	0,08	EUR 200.000	Cie de Financement Foncier 1,25% 15/11/2032	181.567	0,02
COP 6.216.900.000	Colombian TES 6,25% 26/11/2025	1.416.580	0,15	EUR 200.000	Credit Agricole 3,875% 20/4/2031	215.034	0,02
COP 1.074.000.000	Colombian TES 7,25% 26/10/2050	179.698	0,02	EUR 400.000	Credit Agricole Home Loan SFH 0,375% 30/9/2024	418.643	0,05
USD 100.000	Ecopetrol 5,375% 26/6/2026	96.786	0,01	EUR 3.400.000	Credit Agricole Home Loan SFH 0,875% 11/8/2028	3.274.966	0,35
USD 100.000	Ecopetrol 5,875% 28/5/2045*	69.940	0,01	EUR 600.000	Credit Mutuel Home Loan SFH 4,125% 19/1/2024	651.556	0,07
		2.501.292	0,27	EUR 100.000	Crown European 3,375% 15/5/2025	106.560	0,01
	Croatie			EUR 400.000	Electricite de France 4,25% 25/1/2032	431.253	0,05
EUR 630.000	Croatia Government International Bond 1,125% 4/3/2033	537.896	0,06	EUR 300.000	Electricite de France 4,625% 25/1/2043*	312.921	0,03
	République tchèque			GBP 200.000	Electricite de France 6% 29/1/2026	235.403	0,02
CZK 9.800.000	Czech Republic Government Bond 1,75% 23/6/2032	361.781	0,04	EUR 200.000	Forvia 3,75% 15/6/2028	198.715	0,02
CZK 52.960.000	Czech Republic Government Bond 2,75% 23/7/2029	2.185.835	0,23	EUR 25.000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/3/2025*	25.819	0,00
CZK 54.880.000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	2.571.855	0,28	EUR 2.449.000	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/5/2040	1.696.780	0,18
		5.119.471	0,55	EUR 2.720.000	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/6/2044	1.711.961	0,19
	Danemark			EUR 390.000	French Republic Government Bond OAT 0,5% 25/5/2072*	151.205	0,02
EUR 2.219.000	Danske Bank 4,125% 10/1/2031	2.410.503	0,26	EUR 3.220.000	French Republic Government Bond OAT 0,75% 25/2/2028	3.189.989	0,34
DKK 4.800.000	Denmark Government Bond 0,5% 15/11/2027	639.239	0,07	EUR 2.000.000	French Republic Government Bond OAT 1,5% 25/5/2050	1.445.906	0,16
DKK 4.300.000	Denmark Government Bond 4,5% 15/11/2039	760.267	0,08	EUR 240.000	French Republic Government Bond OAT 2% 25/5/2048	199.183	0,02
		3.810.009	0,41	EUR 10.000	French Republic Government Bond OAT 3,25% 25/5/2045	10.607	0,00
	Finlande			EUR 519.000	French Republic Government Bond OAT 4% 25/4/2060	624.074	0,07
EUR 100.000	Ahlstrom 3 Oy 3,625% 4/2/2028	90.956	0,01	EUR 100.000	Goldstory 5,375% 1/3/2026*	104.889	0,01
EUR 630.000	Finland Government Bond 0,125% 15/9/2031	545.603	0,06	EUR 100.000	iliad 5,625% 15/2/2030	105.674	0,01
EUR 150.000	Finland Government Bond 0,125% 15/4/2052*	72.696	0,01	EUR 100.000	Loxam 3,75% 15/7/2026	102.225	0,01
EUR 80.000	Finland Government Bond 1,375% 15/4/2047	61.073	0,00	EUR 100.000	Orange 2,375% 15/1/2025	103.683	0,01
EUR 170.000	Finland Government Bond 2,625% 4/7/2042	169.582	0,02	EUR 200.000	Picard Groupe 3,875% 1/7/2026	200.424	0,02
		939.910	0,10	EUR 200.000	RCI Banque 2,625% 18/2/2030	204.241	0,03
	France			EUR 400.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 3,75% 4/7/2035	430.241	0,05
EUR 100.000	Accor 4,375% 31/1/2024	107.336	0,01	EUR 2.100.000	Societe Du Grand Paris EPIC 1,125% 25/5/2034*	1.801.872	0,19
EUR 100.000	Air France-KLM 7,25% 31/5/2026*	111.354	0,01	EUR 100.000	Societe Generale 1% 24/11/2030	97.960	0,01
EUR 100.000	Altice France 2,125% 15/2/2025	100.629	0,01	GBP 100.000	Societe Generale 1,875% 3/10/2024	120.888	0,01
EUR 1.700.000	Banque Federative du Credit Mutuel 3,625% 14/9/2032*	1.780.563	0,19	GBP 100.000	TotalEnergies Capital International 1,66% 22/7/2026	114.588	0,01
EUR 1.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel 3,75% 1/2/2033*	1.155.512	0,13	EUR 100.000	Veolia Environnement 0,8% 15/1/2032	85.825	0,01
GBP 100.000	BNP Paribas 1,875% 14/12/2027	106.003	0,01	EUR 100.000	Veolia Environnement 1,625% 1/6/2026	95.638	0,01
GBP 100.000	BNP Paribas 3,375% 23/1/2026	118.832	0,01	EUR 580.000	WPP Finance 4,125% 30/5/2028	629.727	0,07
EUR 200.000	BPCE 0,625% 28/4/2025	205.398	0,02			26.616.712	2,87
EUR 400.000	BPCE SFH 0,75% 2/9/2025	409.979	0,05				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 255.000	Avoca CLO XXII 4,963% 15/4/2035	265.680	0,03	EUR 115.000	Banco BPM 3,25% 14/1/2031	116.035	0,01
EUR 350.000	CRH SMW Finance 4,25% 11/7/2035	375.804	0,04	EUR 150.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	163.802	0,02
EUR 318.000	CVC Cordatus Loan Fund IV 5,116% 22/2/2034	330.479	0,04	EUR 100.000	Castor 8,776% 15/2/2029	102.617	0,01
EUR 250.000	CVC Cordatus Loan Fund V 5,146% 21/7/2030	266.719	0,03	EUR 100.000	Cedacri Mergesco 9,281% 15/5/2028	106.874	0,01
EUR 150.000	Henley CLO IV 5,071% 25/4/2034	157.282	0,02	EUR 100.000	doValue 3,375% 31/7/2026	92.949	0,01
EUR 172.000	Invesco Euro CLO III 5,413% 15/7/2032	180.101	0,02	EUR 100.000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11,125% 15/5/2028	108.465	0,01
EUR 250.000	Invesco Euro CLO IV 5,363% 15/4/2033	262.982	0,03	EUR 1.230.000	Eni 1% 11/10/2034	977.375	0,10
EUR 500.000	Invesco Euro CLO V 7,463% 15/1/2034	500.558	0,05	EUR 1.169.000	Eni 4,25% 19/5/2033	1.260.945	0,14
EUR 990.000	Ireland Government Bond 1,7% 15/5/2037	893.648	0,10	EUR 100.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,625% 21/10/2028	95.688	0,01
EUR 551.000	Ireland Government Bond 3% 18/10/2043	575.058	0,06	EUR 260.000	Intesa Sanpaolo 0,75% 4/12/2024	270.783	0,03
GBP 400.000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 7,486% 17/8/2033	507.123	0,06	GBP 100.000	Intesa Sanpaolo 5,148% 10/6/2030	106.425	0,01
EUR 499.897	Last Mile PE 2021 4,687% 17/8/2031	523.723	0,06	EUR 850.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,1% 1/4/2027	848.106	0,09
EUR 151.968	Last Mile PE 2021 4,987% 17/8/2031	154.944	0,02	EUR 2.256.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,45% 1/3/2036*	1.791.567	0,19
EUR 136.971	Last Mile PE 2021 5,387% 17/8/2031	136.949	0,02	EUR 2.526.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,5% 30/4/2045	1.651.835	0,18
EUR 500.000	Linde 1,375% 31/3/2031	468.110	0,05	EUR 866.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,45% 1/9/2050*	650.945	0,07
EUR 1.100.000	Linde 3,375% 12/6/2029	1.187.580	0,13	EUR 10.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,5% 15/11/2025	10.625.276	1,15
EUR 200.000	LT Autorahoitus III 6,373% 17/12/2032	221.101	0,02	EUR 3.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,5% 1/12/2032*	2.891.850	0,31
EUR 252.616	Lt Autorahoitus IV 4,313% 18/7/2033	274.576	0,03	EUR 5.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,7% 1/3/2047*	4.093	0,00
EUR 250.000	Northwoods Capital 19 Euro 6,326% 25/11/2033	262.718	0,03	EUR 1.970.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,95% 1/9/2038	1.814.529	0,20
EUR 269.055	Pearl Finance 2020 5,687% 17/11/2032	285.918	0,03	EUR 5.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,45% 1/3/2048*	4.638	0,00
EUR 212.412	Pearl Finance 2020 6,287% 17/11/2032	224.406	0,02	EUR 270.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,85% 1/9/2049	266.402	0,03
EUR 96.500	River Green Finance 2020 4,748% 22/1/2032	99.299	0,01	EUR 3.010.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4% 30/10/2031	3.291.500	0,36
EUR 527.000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 5,305% 20/1/2033	554.198	0,06	EUR 219.504	Koromo Italy 4,432% 26/2/2035	238.608	0,02
EUR 999.000	RRE 5 Loan Management 5,413% 15/1/2037	1.057.016	0,11	EUR 216.000	Telecom Italia 1,625% 18/1/2029*	184.706	0,02
EUR 250.000	Sound Point Euro CLO III Funding 5,963% 15/4/2033	262.398	0,03	EUR 200.000	Telecom Italia 2,75% 15/4/2025	208.879	0,03
GBP 555.632	Taurus 2019-2 UK 7,138% 17/11/2029	684.005	0,07	EUR 100.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	109.714	0,01
GBP 408.413	Taurus 2019-2 UK 7,438% 17/11/2029	495.599	0,05	EUR 150.000	UniCredit 4,45% 16/2/2029	159.880	0,02
GBP 110.191	Taurus 2021-1 UK 6,519% 17/5/2031	131.951	0,01	USD 200.000	UniCredit 7,296% 2/4/2034	191.359	0,02
GBP 99.271	Taurus 2021-1 UK 6,869% 17/5/2031	116.528	0,01			28.591.449	3,09
GBP 145.928	Taurus 2021-1 UK 7,819% 17/5/2031	177.471	0,02		Japon		
EUR 158.000	Voya Euro CLO III 5,313% 15/4/2033	166.782	0,02	EUR 230.000	Asahi 0,155% 23/10/2024	238.810	0,03
EUR 1.186.000	Voya Euro CLO IV 5,413% 15/10/2034	1.255.688	0,13	JPY 100.000.000	Japan Expressway and Debt Repayment Agency 0,306% 31/3/2050	493.998	0,05
		13.986.105	1,51	JPY 607.200.000	Japan Government Forty Year Bond 0,5% 20/3/2059	2.884.632	0,31
	Italie			JPY 57.900.000	Japan Government Forty Year Bond 0,7% 20/3/2061	290.041	0,03
EUR 149.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	157.534	0,02	JPY 560.000.000	Japan Government Forty Year Bond 0,8% 20/3/2058	2.994.662	0,32
EUR 100.000	Azzurra Aeroporti 2,625% 30/5/2027	98.070	0,01	JPY 121.200.000	Japan Government Forty Year Bond 0,9% 20/3/2057	675.056	0,07
				JPY 191.800.000	Japan Government Forty Year Bond 1% 20/3/2062	1.053.854	0,11
				JPY 2.322.200.000	Japan Government Ten Year Bond 0,1% 20/12/2030	15.519.522	1,68
				JPY 525.000.000	Japan Government Ten Year Bond 0,1% 20/9/2031	3.482.950	0,38
				JPY 143.050.000	Japan Government Ten Year Bond 0,5% 20/3/2033	968.846	0,11
				JPY 125.600.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,6% 20/9/2050	676.279	0,07

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
JPY 110.150.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,7% 20/12/2048	625.132	0,07	EUR 39.997	Germany Compartment Consumer 2020-1 5,371% 14/11/2034	43.368	0,01
JPY 753.500.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,7% 20/9/2051	4.135.113	0,45	EUR 39.998	Germany Compartment Consumer 2020-1 6,121% 14/11/2034	43.189	0,00
JPY 230.200.000	Japan Government Thirty Year Bond 1,3% 20/6/2052	1.469.024	0,16	USD 174.000	Medtronic Global 4,5% 30/3/2033	168.389	0,02
JPY 193.650.000	Japan Government Thirty Year Bond 1,4% 20/3/2053	1.265.075	0,14	USD 200.000	Rumo Luxembourg 5,25% 10/1/2028	188.142	0,02
JPY 151.850.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,3% 20/9/2039	911.708	0,10	EUR 100.000	SES 2,875% 27/5/2026	94.624	0,01
JPY 603.650.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,4% 20/6/2040	3.635.613	0,39	EUR 100.000	Stena International 7,25% 15/2/2028	112.241	0,01
JPY 122.000.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,6% 20/6/2037	795.753	0,09	EUR 400.000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024*	419.540	0,05
JPY 3.500.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,6% 20/12/2037	22.666	0,00			4.390.601	0,48
JPY 33.200.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,7% 20/3/2037	220.015	0,02		Malaisie		
JPY 14.100.000	Japanese Government CPI Linked Bond 0,1% 10/9/2023	107.008	0,01	MYR 4.420.000	Malaysia Government Bond 4,893% 8/6/2038	1.042.724	0,11
USD 200.000	Mitsubishi UFJ Financial 2,309% 20/7/2032*	158.426	0,02	MYR 5.600.000	Malaysia Government Investment Issue 4,07% 30/9/2026	1.228.566	0,13
USD 200.000	Mitsubishi UFJ Financial 5,441% 22/2/2034	198.036	0,02	MYR 5.200.000	Malaysia Government Investment Issue 4,245% 30/9/2030	1.153.290	0,13
EUR 2.596.000	Nissan Motor 3,201% 17/9/2028*	2.572.649	0,28	MYR 500.000	Malaysia Government Investment Issue 4,662% 31/3/2038	115.750	0,01
EUR 200.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	209.888	0,02	USD 500.000	Malaysia Sukuk Global 3,179% 27/4/2026*	479.382	0,05
EUR 100.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032	85.000	0,01			4.019.712	0,43
USD 381.000	Takeda Pharmaceutical 2,05% 31/3/2030	313.313	0,03		Mexique		
		46.003.069	4,97	USD 200.000	America Movil 4,375% 16/7/2042	169.978	0,02
	Jersey			USD 730.000	America Movil 4,7% 21/7/2032	693.638	0,07
USD 500.000	AGL CLO 20 8,276% 20/7/2035	502.750	0,06	USD 950.000	GCC 3,614% 20/4/2032	795.972	0,09
GBP 110.000	Galaxy Bidco 6,5% 31/7/2026	128.439	0,02	MXN 139.441.300	Mexican Bonos 7,75% 29/5/2031	7.585.641	0,82
GBP 10.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 5,844% 5/11/2031	12.687	0,00	MXN 18.000.000	Mexican Bonos 7,75% 23/11/2034	960.172	0,10
		643.876	0,08	MXN 34.000.000	Mexican Bonos 8% 7/12/2023	2.014.077	0,22
	Kazakhstan			MXN 50.000.000	Mexican Bonos 8% 24/5/2035	2.715.830	0,29
USD 200.000	Kazakhstan Government International Bond 4,875% 14/10/2044	179.181	0,02	MXN 19.000.000	Mexican Bonos 8,5% 31/5/2029	1.090.518	0,12
USD 200.000	Kazakhstan Government International Bond 5,125% 21/7/2025	204.477	0,02	MXN 243.301.600	Mexico Cetes 0% 30/5/2024	1.338.236	0,14
USD 200.000	KazMunayGas National JSC 4,75% 19/4/2027	188.315	0,02	MXN 782.125.600	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	4.238.259	0,46
		571.973	0,06	EUR 190.000	Mexico Government International Bond 1,35% 18/9/2027	186.278	0,02
	Luxembourg			EUR 260.000	Mexico Government International Bond 2,25% 12/8/2036	205.102	0,02
EUR 100.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3,625% 1/6/2028*	89.096	0,01	USD 600.000	Mexico Government International Bond 4,6% 23/1/2046	485.955	0,05
EUR 147.000	BL Consumer Credit 2021 5,292% 25/9/2038	157.924	0,02	USD 650.000	Mexico Government International Bond 4,875% 19/5/2033*	616.710	0,07
EUR 191.000	BL Consumer Credit 2021 6,492% 25/9/2038	203.935	0,02	USD 230.000	Mexico Government International Bond 6,338% 4/5/2053*	229.310	0,03
GBP 100.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	112.021	0,01			23.325.676	2,52
EUR 100.000	Cullinan Holdco Scsp 8,413% 15/10/2026	101.591	0,01		Pays-Bas		
EUR 100.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	111.270	0,01	EUR 200.000	Abertis Infraestructuras Finance 3,248% 24/11/2025	197.037	0,02
EUR 2.390.000	European Financial Stability Facility 1,75% 17/7/2053	1.804.229	0,20	EUR 300.000	ABN AMRO Bank 0,875% 14/1/2026	306.259	0,04
EUR 640.000	European Financial Stability Facility 2,375% 21/6/2032	656.974	0,07				
EUR 100.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	84.068	0,01				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 200.000	ABN AMRO Bank 1,45% 12/4/2038	169.484	0,02				
EUR 450.000	ABN AMRO Bank 2,5% 5/9/2023	488.201	0,05				
EUR 100.000	Ashland Services 2% 30/1/2028	93.699	0,01				
EUR 606.000	BP Capital Markets 4,323% 12/5/2035*	651.901	0,07				
USD 200.000	Braskem Netherlands Finance 4,5% 10/1/2028	180.921	0,02				
EUR 200.000	Cooperatieve Rabobank 1,5% 26/4/2038*	170.108	0,02				
GBP 100.000	Cooperatieve Rabobank 1,875% 12/7/2028*	109.081	0,01				
EUR 400.000	Digital Dutch Finco 0,625% 15/7/2025	400.829	0,05				
EUR 141.017	Domi 2023-1 4,901% 15/2/2055	154.103	0,02				
EUR 125.000	Dutch Property Finance 2020-2 5,064% 28/1/2058	135.240	0,01				
EUR 178.000	Dutch Property Finance 2021-1 4,814% 28/7/2058	191.753	0,02				
EUR 300.000	Enel Finance International 0% 17/6/2024	315.467	0,04				
EUR 500.000	ING Bank 0,875% 11/4/2028	488.013	0,05				
EUR 200.000	ING Groep 0,1% 3/9/2025	208.273	0,02				
GBP 100.000	ING Groep 3% 18/2/2026	117.826	0,01				
EUR 1.900.000	ING Groep 4,5% 23/5/2029	2.058.837	0,22				
EUR 100.000	Koninklijke KPN 2% 8/11/2024	103.536	0,01				
EUR 100.000	Naturgy Finance 3,375% 24/4/2024	106.596	0,01				
EUR 1.110.000	Netherlands Government Bond 0% 15/7/2030	1.001.065	0,11				
EUR 1.620.000	Netherlands Government Bond 0,25% 15/7/2029	1.525.672	0,16				
EUR 693.000	Netherlands Government Bond 2,75% 15/1/2047*	736.411	0,08				
EUR 1.040.000	Netherlands Government Bond 4% 15/1/2037	1.263.587	0,14				
USD 785.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3,4% 1/5/2030	688.688	0,08				
USD 207.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033*	196.756	0,02				
EUR 100.000	OI European 6,25% 15/5/2028	111.209	0,01				
USD 460.000	Prosus 4,987% 19/1/2052*	310.454	0,04				
EUR 200.000	Q-Park I 5,47% 1/3/2026	212.984	0,03				
EUR 100.000	Repsol International Finance 4,247% 11/9/2028	98.757	0,01				
USD 446.000	Shell International Finance 2,75% 6/4/2030	392.862	0,04				
EUR 100.000	Siemens Financieringsmaatschappij 0,3% 28/2/2024	106.670	0,01				
EUR 118.443	Summer BidCo 9% 15/11/2025	120.693	0,01				
EUR 500.000	Telefonica Europe 4,375% 14/12/2024	533.441	0,06				
EUR 200.000	Telefonica Europe 6,135% 3/2/2030	212.365	0,02				
EUR 200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1,875% 31/3/2027	186.682	0,02				
EUR 100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,375% 15/9/2029	111.372	0,01				
EUR 570.000	Viterra Finance 0,375% 24/9/2025*	568.809	0,06				
EUR 800.000	Viterra Finance 1% 24/9/2028*	735.181	0,08				
EUR 200.000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026	200.059	0,02				
		15.960.881	1,73				
					Nouvelle-Zélande		
EUR 2.051.000	Chorus 3,625% 7/9/2029	2.171.061	0,24				
NZD 1.000.000	New Zealand Government Bond 4,25% 15/5/2034	562.695	0,06				
NZD 555.000	New Zealand Government Bond 4,5% 15/4/2027	324.712	0,04				
NZD 1.000.000	New Zealand Government Bond 4,5% 15/5/2030	582.081	0,06				
		3.640.549	0,40				
					Norvège		
NOK 6.650.000	Norway Government Bond 1,75% 17/2/2027	578.736	0,06				
NOK 13.000.000	Norway Government Bond 3% 15/8/2033	1.140.635	0,13				
		1.719.371	0,19				
					Panama		
EUR 100.000	Carnival 7,625% 1/3/2026	108.261	0,01				
USD 400.000	Panama Government International Bond 3,875% 17/3/2028	376.594	0,04				
USD 200.000	Panama Government International Bond 4,5% 15/5/2047*	153.320	0,02				
		638.175	0,07				
					Pérou		
USD 460.000	Peruvian Government International Bond 2,783% 23/1/2031	390.538	0,04				
USD 600.000	Peruvian Government International Bond 2,844% 20/6/2030*	519.027	0,06				
USD 260.000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034*	211.198	0,02				
		1.120.763	0,12				
					Philippines		
PHP 19.300.000	Philippine Government Bond 7% 13/7/2038	356.927	0,04				
USD 500.000	Philippine Government International Bond 3,7% 1/3/2041	402.260	0,05				
USD 200.000	Philippine Government International Bond 5,95% 13/10/2047	212.157	0,02				
		971.344	0,11				
					Pologne		
PLN 5.930.000	Republic of Poland Government Bond 2,5% 25/7/2026	1.335.139	0,14				
PLN 3.300.000	Republic of Poland Government Bond 2,5% 25/7/2027	723.294	0,08				
PLN 460.000	Republic of Poland Government Bond 2,75% 25/10/2029*	96.669	0,01				
PLN 4.945.000	Republic of Poland Government Bond 4% 25/10/2023	1.198.830	0,13				
EUR 500.000	Republic of Poland Government International Bond 1,375% 22/10/2027*	499.853	0,05				
EUR 500.000	Republic of Poland Government International Bond 1,5% 9/9/2025	520.112	0,06				
USD 500.000	Republic of Poland Government International Bond 3,25% 6/4/2026*	478.753	0,05				
		4.852.650	0,52				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Portugal				EUR 520.000	Slovenia Government Bond 3,625% 11/3/2033	573.706	0,06
EUR 200.000	EDP - Energias de Portugal 1,7% 20/7/2080*	200.552	0,02			662.139	0,07
EUR 610.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1,95% 15/6/2029	626.260	0,07	Afrique du Sud			
EUR 1.570.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2,125% 17/10/2028	1.639.829	0,18	ZAR 25.049.920	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	1.196.253	0,13
EUR 357.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4,1% 15/4/2037	410.100	0,04	ZAR 3.793.216	Republic of South Africa Government Bond 8,75% 31/1/2044*	146.928	0,01
EUR 22.135	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos 0,7% 12/2/2024	23.770	0,00	ZAR 44.705.782	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	1.822.908	0,20
		2.900.511	0,31	ZAR 39.846.798	Republic of South Africa Government Bond 10,5% 21/12/2026	2.218.925	0,24
Qatar						5.385.014	0,58
USD 500.000	Qatar Government International Bond 3,25% 2/6/2026	479.050	0,05	Corée du Sud			
USD 280.000	Qatar Government International Bond 3,75% 16/4/2030	265.332	0,03	USD 600.000	Korea International Bond 2,75% 19/1/2027*	565.341	0,06
USD 300.000	Qatar Government International Bond 4% 14/3/2029*	290.120	0,03	KRW 743.530.000	Korea Treasury Bond 1,125% 10/9/2025	534.329	0,06
USD 200.000	Qatar Government International Bond 4,625% 2/6/2046	183.440	0,02	KRW 2.190.680.000	Korea Treasury Bond 1,125% 10/9/2039	1.134.320	0,12
USD 200.000	Qatar Government International Bond 5,103% 23/4/2048	191.744	0,02	KRW 2.686.940.000	Korea Treasury Bond 1,25% 10/3/2026	1.913.313	0,21
		1.409.686	0,15	KRW 3.290.120.000	Korea Treasury Bond 1,5% 10/3/2025	2.407.862	0,26
Roumanie				KRW 4.904.750.000	Korea Treasury Bond 1,875% 10/6/2029	3.358.793	0,36
RON 1.870.000	Romania Government Bond 4,15% 26/1/2028*	376.639	0,04	KRW 1.200.000.000	Korea Treasury Bond 2% 10/3/2046	665.612	0,07
EUR 2.530.000	Romanian Government International Bond 2,375% 19/4/2027	2.535.791	0,28	KRW 1.702.290.000	Korea Treasury Bond 2% 10/3/2049	919.035	0,10
		2.912.430	0,32	KRW 420.000.000	Korea Treasury Bond 2,125% 10/3/2047	236.964	0,03
Arabie Saoudite				KRW 2.169.270.000	Korea Treasury Bond 2,25% 10/12/2025	1.589.204	0,17
USD 270.000	Saudi Government International Bond 3,25% 22/10/2030	243.301	0,03	KRW 530.000.000	Korea Treasury Bond 2,375% 10/9/2038	337.678	0,04
USD 770.000	Saudi Government International Bond 3,45% 2/2/2061*	512.724	0,06	USD 200.000	POSCO 2,75% 15/7/2024	194.738	0,02
USD 400.000	Saudi Government International Bond 3,625% 4/3/2028	377.872	0,04			13.857.189	1,50
USD 400.000	Saudi Government International Bond 4,5% 17/4/2030*	390.406	0,04	Espagne			
		1.524.303	0,17	EUR 61.054	Autonomia Spain 2021 FT 7,542% 31/1/2039	63.486	0,01
Singapour				EUR 87.017	Autonomia Spain 2022 FT 6,442% 27/1/2040	95.265	0,01
USD 315.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	315.653	0,04	EUR 87.018	Autonomia Spain 2022 FT 10,642% 29/1/2040	95.815	0,01
USD 1.432.000	Pfizer Investment Enterprises 5,34% 19/5/2063	1.414.263	0,15	EUR 100.000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	101.141	0,01
SGD 1.920.000	Singapore Government Bond 2% 1/2/2024	1.410.071	0,15	EUR 100.000	Banco de Sabadell 5,25% 7/2/2029	107.852	0,01
SGD 700.000	Singapore Government Bond 2,75% 1/4/2042	493.729	0,05	GBP 300.000	Banco Santander 3,125% 6/10/2026	351.904	0,04
SGD 1.050.000	Singapore Government Bond 3,5% 1/3/2027	783.060	0,09	EUR 200.000	CaixaBank 1,125% 17/5/2024	212.488	0,02
USD 250.000	Temasek Financial I 3,625% 1/8/2028	238.856	0,02	EUR 1.200.000	CaixaBank 4,125% 24/3/2036	1.358.252	0,15
		4.655.632	0,50	EUR 100.000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	94.491	0,01
Slovaquie				EUR 100.000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	85.440	0,01
EUR 580.000	Slovakia Government Bond 0,75% 9/4/2030	528.123	0,06	EUR 100.000	Cellnex Telecom 1% 20/4/2027	96.538	0,01
Slovénie				EUR 100.000	Food Service Project 5,5% 21/1/2027	103.549	0,01
EUR 110.000	Slovenia Government Bond 1,75% 3/11/2040	88.433	0,01	EUR 38.864	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5,522% 21/3/2033	41.514	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 100.000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	100.956	0,01	THB 25.320.000	Thailand Government Bond 2,875% 17/6/2046	678.645	0,07
EUR 3.068.000	Spain Government Bond 0,1% 30/4/2031	2.614.342	0,28	THB 10.510.000	Thailand Government Bond 3,3% 17/6/2038	311.026	0,04
EUR 1.030.000	Spain Government Bond 0,5% 31/10/2031	892.659	0,10	THB 25.820.000	Thailand Government Bond 3,35% 17/6/2033	773.670	0,08
EUR 730.000	Spain Government Bond 0,7% 30/4/2032	637.414	0,07	USD 200.000	Thaioil Treasury Center 3,75% 18/6/2050*	128.488	0,01
EUR 3.421.000	Spain Government Bond 0,85% 30/7/2037	2.556.437	0,28			2.727.756	0,30
EUR 1.013.000	Spain Government Bond 1% 31/10/2050*	563.670	0,06	Émirats arabes unis			
EUR 212.000	Spain Government Bond 2,35% 30/7/2033*	209.004	0,02	USD 500.000	Abu Dhabi Commercial Bank 4,5% 14/9/2027	486.200	0,05
EUR 1.400.000	Spain Government Bond 3,45% 30/7/2066	1.327.301	0,14	USD 670.000	Abu Dhabi Government International Bond 3,125% 16/4/2030*	613.083	0,07
EUR 6.950.000	Spain Government Bond 3,55% 31/10/2033	7.572.831	0,82	USD 760.000	Abu Dhabi Government International Bond 4,125% 11/10/2047*	641.083	0,07
EUR 28.000	Spain Government Bond 5,15% 31/10/2044*	35.639	0,00			1.740.366	0,19
GBP 200.000	Telefonica Emisiones 5,375% 2/2/2026	250.311	0,03	Royaume-Uni			
		19.568.299	2,11	USD 2.152.000	Anglo American Capital 4% 11/9/2027	2.030.769	0,22
Suède				EUR 1.799.000	Anglo American Capital 4,75% 21/9/2032*	1.928.922	0,21
SEK 7.400.000	Nordea Hypotek 1,25% 20/9/2023	677.551	0,07	GBP 100.000	Atlas Funding 2021-1 6,874% 25/7/2058	126.459	0,01
EUR 350.000	Stadshypotek 0,5% 11/7/2025	358.463	0,04	GBP 284.884	Atlas Funding 2023-1 6,345% 20/1/2061	361.621	0,04
SEK 11.000.000	Stadshypotek 1,5% 1/3/2024	996.048	0,11	GBP 100.000	Atlas Funding 2023-1 7,095% 20/1/2061	126.382	0,01
GBP 100.000	Swedbank 1,375% 8/12/2027	108.262	0,01	GBP 72.338	Azure Finance NO 2 8,195% 20/7/2030	91.893	0,01
SEK 11.000.000	Swedbank Hypotek 1% 20/12/2023	999.351	0,11	USD 259.000	Barclays 2,894% 24/11/2032	202.315	0,02
SEK 4.110.000	Sweden Government Bond 0,75% 12/5/2028*	342.092	0,04	GBP 100.000	Barclays 3% 8/5/2026	115.966	0,01
SEK 12.000.000	Sweden Government Bond 1,75% 11/11/2033	1.008.499	0,11	GBP 100.000	Barclays 3,25% 12/2/2027	113.835	0,01
SEK 2.300.000	Sweden Government Bond 3,5% 30/3/2039	227.243	0,02	EUR 1.024.000	Barclays 5,262% 29/1/2034	1.110.745	0,12
		4.717.509	0,51	USD 253.000	Barclays 5,746% 9/8/2033	242.508	0,03
Suisse				GBP 200.000	Bellis Acquisition 4,5% 16/2/2026	222.660	0,03
CHF 1.510.000	Swiss Confederation Government Bond 0% 22/6/2029	1.618.720	0,18	GBP 200.000	BG Energy Capital 5,125% 1/12/2025	250.497	0,03
CHF 1.420.000	Swiss Confederation Government Bond 0% 26/6/2034	1.452.462	0,16	EUR 100.000	BP Capital Markets 2,822% 7/4/2032	99.581	0,01
CHF 460.000	Swiss Confederation Government Bond 0,25% 23/6/2035	479.891	0,05	GBP 209.000	Brants Bridge 2023-1 5,952% 14/6/2066	264.258	0,03
CHF 200.000	Swiss Confederation Government Bond 2% 25/6/2064	320.184	0,03	GBP 100.000	British Telecommunications 8,375% 20/12/2083	126.963	0,02
CHF 2.780.000	Swiss Confederation Government Bond 3,5% 8/4/2033	3.891.866	0,42	GBP 115.000	Canada Square Funding 6 6,601% 17/1/2059	139.455	0,02
EUR 400.000	UBS 1,25% 17/4/2025	424.817	0,04	GBP 130.000	Canada Square Funding 6 7,001% 17/1/2059	153.424	0,02
USD 966.000	UBS 3,091% 14/5/2032	796.429	0,09	EUR 350.000	Channel Link Enterprises Finance 2,706% 30/6/2050	347.133	0,04
USD 564.000	UBS 3,75% 26/3/2025	545.186	0,06	GBP 110.000	CMF 2020-1 6,196% 16/1/2057	139.250	0,02
USD 655.000	UBS 6,537% 12/8/2033	681.872	0,07	GBP 100.000	Dowson 2022-2 10,445% 20/8/2029	126.743	0,01
		10.211.427	1,10	EUR 860.000	DS Smith 4,5% 27/7/2030*	927.324	0,10
Thaïlande				EUR 200.000	EC Finance 3% 15/10/2026	204.172	0,02
USD 200.000	Bangkok Bank 3,733% 25/9/2034	170.102	0,02	GBP 100.000	Funding V 6,895% 15/10/2025	126.575	0,01
USD 200.000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025	189.400	0,02	GBP 500.000	Funding VI 6,595% 15/7/2026	634.867	0,07
USD 200.000	GC Treasury Center 2,98% 18/3/2031	159.149	0,02	GBP 100.000	Funding VI 8,295% 15/7/2026	127.551	0,02
THB 12.800.000	Thailand Government Bond 1,585% 17/12/2035	317.276	0,04	GBP 100.000	Gemgarto 2021-1 6,297% 16/12/2067	124.456	0,01
				GBP 186.222	Greene King Finance 4,064% 15/3/2035	199.160	0,02
				GBP 181.000	Harben Finance 6,242% 28/9/2055	218.948	0,02
				GBP 179.000	Harben Finance 6,592% 28/9/2055	209.142	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
GBP 200.000	Heathrow Finance 3,875% 1/3/2027*	218.824	0,02	GBP 305.000	Turbo Finance 9 6,845% 20/8/2028	387.866	0,04
GBP 100.000	Hermitage 2023 7,646% 21/9/2033	126.885	0,01	GBP 115.000	Twin Bridges 2020-1 7,208% 12/12/2054	145.823	0,02
GBP 99.996	Hops Hill No 1 7,045% 27/5/2054	126.449	0,01	GBP 125.000	Twin Bridges 2020-1 7,958% 12/12/2054	158.020	0,02
GBP 99.998	Hops Hill No 1 7,545% 27/5/2054	124.930	0,01	GBP 138.000	Twin Bridges 2021-1 6,558% 12/3/2055	171.225	0,02
GBP 100.000	Hops Hill No2 7,445% 27/11/2054	127.789	0,01	GBP 100.000	Twin Bridges 2021-1 7,058% 12/3/2055	123.010	0,01
GBP 100.000	Hops Hill No2 8,045% 27/11/2054	126.410	0,01	GBP 100.000	Twin Bridges 2022-2 6,958% 12/6/2055	126.930	0,01
GBP 1.604.000	HSBC 1,75% 24/7/2027	1.787.770	0,19	GBP 482.770	Unique Pub Finance 5,659% 30/6/2027	604.388	0,07
EUR 3.242.000	HSBC 4,752% 10/3/2028	3.540.427	0,38	GBP 2.020.000	United Kingdom Gilt 0,125% 31/1/2028*	2.120.413	0,23
EUR 100.000	INEOS Finance 6,625% 15/5/2028	107.948	0,01	GBP 3.860.000	United Kingdom Gilt 0,625% 7/6/2025*	4.547.062	0,49
EUR 100.000	INEOS Quattro Finance 2 2,5% 15/1/2026	98.945	0,01	GBP 2.780.000	United Kingdom Gilt 0,875% 31/7/2033	2.539.213	0,27
EUR 118.000	Informa 2,125% 6/10/2025	122.693	0,01	GBP 2.170.000	United Kingdom Gilt 1,125% 22/10/2073*	1.002.543	0,11
GBP 1.204.000	Informa 3,125% 5/7/2026*	1.407.274	0,15	GBP 1.140.000	United Kingdom Gilt 1,5% 31/7/2053	726.029	0,08
GBP 140.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7,208% 12/6/2057	176.269	0,02	GBP 1.998.000	United Kingdom Gilt 1,75% 22/1/2049	1.455.061	0,16
GBP 200.000	Lloyds Banking 2,25% 16/10/2024	242.954	0,03	GBP 860.000	United Kingdom Gilt 4,5% 7/6/2028*	1.082.330	0,12
GBP 50.000	Mitchells & Butlers Finance 7,347% 15/6/2036	51.406	0,01	GBP 100.000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	115.800	0,01
GBP 100.000	Mortimer BTL 2021-1 6,483% 23/6/2053	122.381	0,01			41.708.692	4,51
EUR 234.000	National Grid Electricity Transmission 0,19% 20/1/2025	240.993	0,03		États-Unis		
EUR 500.000	Nationwide Building Society 1,125% 31/5/2028	488.532	0,05	USD 881.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 3,901% 10/8/2035	826.924	0,09
GBP 100.000	NatWest 2,875% 19/9/2026*	117.211	0,01	USD 750.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	661.622	0,07
GBP 100.000	NatWest 3,125% 28/3/2027	116.142	0,01	USD 840.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	760.996	0,08
GBP 128.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6,745% 15/3/2029	161.792	0,02	USD 613.000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3,779% 5/6/2037	475.274	0,05
GBP 136.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6,545% 15/11/2029	170.431	0,02	USD 870.000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3,779% 5/6/2037	727.419	0,08
GBP 100.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-2 10,195% 15/7/2030	128.164	0,02	USD 820.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 6,902% 15/9/2034	740.291	0,08
EUR 41.819	Paragon Mortgages No 12 4,261% 15/11/2038	42.574	0,01	USD 3.752.000	AbbVie 3,2% 21/11/2029	3.381.446	0,37
GBP 421.944	Parkmore Point RMBS 2022-1 6,673% 25/7/2045	530.352	0,06	USD 794.000	Amazon.com 2,5% 3/6/2050	507.720	0,06
GBP 100.000	Pinewood Finance 3,25% 30/9/2025	117.797	0,01	USD 419.000	Amazon.com 4,7% 1/12/2032	416.649	0,05
GBP 100.000	Premier Foods Finance 3,5% 15/10/2026	114.694	0,01	USD 19.215	American Airlines 2017-1 Class AA Pass Through Trust 3,65% 15/2/2029	17.616	0,00
GBP 100.000	Residential Mortgage 32 7,225% 20/6/2070	126.328	0,01	USD 392.919	American Airlines 2019-1 Class AA Pass Through Trust 3,15% 15/2/2032	344.060	0,04
GBP 150.000	Sage AR Funding No 1 7,369% 17/11/2030	179.456	0,02	USD 271.000	American Express 4,42% 3/8/2033	251.341	0,03
EUR 380.000	Santander UK 0,5% 10/1/2025	393.935	0,04	USD 1.209.241	American Homes 4 Rent 2015-SFR2 Trust 3,732% 17/10/2052	1.162.277	0,13
GBP 100.000	Santander UK 3,625% 14/1/2026	118.113	0,01	EUR 640.000	American Tower 0,4% 15/2/2027	607.982	0,07
EUR 2.144.000	Standard Chartered 0,8% 17/11/2029	1.936.019	0,21	EUR 775.000	American Tower 0,875% 21/5/2029	690.530	0,08
EUR 907.000	Standard Chartered 4,874% 10/5/2031	982.728	0,11	EUR 609.000	American Tower 0,95% 5/10/2030	523.025	0,06
GBP 124.000	Tower Bridge Funding 2021-1 7,014% 21/7/2064	156.538	0,02				
GBP 106.000	Tower Bridge Funding 2021-1 7,314% 21/7/2064	133.129	0,02				
GBP 434.008	Tower Bridge Funding 2022-1 5,745% 20/12/2063	545.123	0,06				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 400.000	American Tower 1,95% 22/5/2026*	408.635	0,04	EUR 400.000	Bank of America 4,587% 22/9/2026	433.874	0,05
USD 736.000	American Tower 2,1% 15/6/2030	587.593	0,06	USD 467.000	Bank of America 5,015% 22/7/2033	448.956	0,05
USD 1.210.000	American Tower 2,3% 15/9/2031	947.468	0,10	USD 2.844.000	Bank of America 5,202% 25/4/2029	2.801.099	0,30
USD 125.000	American Tower 4,05% 15/3/2032	111.522	0,01	USD 1.371.491	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5,834% 25/4/2036	1.235.147	0,13
EUR 258.000	American Tower 4,625% 16/5/2031	279.909	0,03	USD 437.798	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 6,104% 25/9/2037	401.008	0,04
USD 1.405.000	American Tower 5,55% 15/7/2033	1.389.613	0,15	USD 2.035.000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6,23% 15/3/2037	1.872.559	0,20
USD 2.092.000	Amgen 2,45% 21/2/2030	1.780.158	0,19	USD 200.000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6,479% 15/3/2037	169.237	0,02
GBP 645.000	Amgen 4% 13/9/2029*	755.986	0,08	USD 550.000	BDS 2022-FL12 7,45% 19/8/2038	549.203	0,06
USD 2.545.000	Amgen 5,25% 2/3/2030	2.549.539	0,28	USD 1.320.667	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 5,749% 25/1/2047	1.083.404	0,12
GBP 100.000	Amgen 5,5% 7/12/2026*	126.128	0,01	EUR 200.000	Belden 3,875% 15/3/2028*	200.828	0,02
USD 784.000	Aon / Aon Global 2,6% 2/12/2031	643.539	0,07	USD 416.000	Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust 4,295% 10/4/2051	339.061	0,04
USD 94.000	Aon / Aon Global 5% 12/9/2032	91.910	0,01	USD 655.682	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust 4,57% 15/7/2051	565.954	0,06
EUR 200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028	180.232	0,02	USD 200.000	Bimbo Bakeries USA 4% 17/5/2051	153.609	0,02
USD 333.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3,25% 1/9/2028	283.124	0,03	EUR 200.000	Boxer Parent 6,5% 2/10/2025	215.600	0,02
USD 1.104.000	AREIT 2022-CRE7 7,556% 17/6/2039	1.104.434	0,12	USD 1.042.000	Broadcom 3,419% 15/4/2033	864.605	0,09
USD 297.000	Astrazeneca Finance 2,25% 28/5/2031	247.159	0,03	USD 834.000	Broadcom 3,469% 15/4/2034	681.814	0,07
USD 1.164.000	AT&T 1,7% 25/3/2026	1.061.613	0,12	USD 217.000	Broadcom 4% 15/4/2029	200.008	0,02
EUR 349.000	AT&T 2,35% 5/9/2029	343.178	0,04	USD 558.000	Broadcom 4,15% 15/11/2030	510.289	0,06
USD 678.000	AT&T 2,55% 1/12/2033	517.584	0,06	USD 125.000	Broadcom 4,15% 15/4/2032	111.993	0,01
GBP 200.000	AT&T 2,9% 4/12/2026	229.641	0,03	USD 725.000	Burlington Northern Santa Fe 4,45% 15/1/2053*	647.521	0,07
USD 1.132.000	AT&T 3,65% 1/6/2051	777.363	0,08	USD 440.000	BXP Trust 2017-GM 3,379% 13/6/2039	398.048	0,04
USD 815.000	AT&T 3,65% 15/9/2059	528.365	0,06	USD 1.220.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	1.054.176	0,11
EUR 1.339.000	AT&T 3,95% 30/4/2031	1.417.781	0,15	USD 730.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	610.278	0,07
EUR 580.000	AT&T 4,3% 18/11/2034*	616.771	0,07	USD 543.000	Cameron LNG 3,302% 15/1/2035	450.110	0,05
GBP 708.000	AT&T 4,375% 14/9/2029*	819.385	0,09	USD 280.000	Cameron LNG 3,402% 15/1/2038	229.791	0,02
USD 220.000	AT&T 5,4% 15/2/2034	213.513	0,02	EUR 100.000	Catalent Pharma Solutions 2,375% 1/3/2028	90.870	0,01
GBP 800.000	AT&T 5,5% 15/3/2027*	988.773	0,11	USD 505.000	CCUBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 4,159% 15/11/2050	434.086	0,05
USD 889.000	Baltimore Gas and Electric 5,4% 1/6/2053	877.971	0,10	USD 37.000	CenterPoint Energy Houston Electric 3,95% 1/3/2048	29.802	0,00
USD 630.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3,716% 14/4/2033	539.049	0,06	USD 711.000	CenterPoint Energy Houston Electric 5,3% 1/4/2053	708.095	0,08
USD 922.024	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 7,058% 15/9/2034	913.483	0,10	USD 33.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2,25% 15/1/2029	27.393	0,00
EUR 2.333.000	Bank of America 0,654% 26/10/2031*	1.984.051	0,21	USD 892.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3,85% 1/4/2061	533.967	0,06
EUR 375.000	Bank of America 0,694% 22/3/2031	325.433	0,04	USD 198.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3,95% 30/6/2062	119.679	0,01
USD 99.000	Bank of America 0,981% 25/9/2025	93.709	0,01	USD 23.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4,4% 1/4/2033	20.216	0,00
EUR 400.000	Bank of America 1,776% 4/5/2027	407.757	0,04	USD 164.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4,8% 1/3/2050	121.639	0,01
USD 128.000	Bank of America 2,299% 21/7/2032	101.033	0,01				
EUR 506.000	Bank of America 2,824% 27/4/2033	490.937	0,05				
USD 1.080.000	Bank of America 2,972% 4/2/2033	888.378	0,09				
USD 1.706.000	Bank of America 3,194% 23/7/2030	1.495.561	0,16				
EUR 2.055.000	Bank of America 4,134% 12/6/2028*	2.227.444	0,24				
USD 2.761.000	Bank of America 4,571% 27/4/2033*	2.560.550	0,28				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 374.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5,375% 1/5/2047	299.228	0,03	USD 304.539	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-25 5,569% 25/6/2037	280.201	0,03
EUR 200.000	Chemours 4% 15/5/2026	204.694	0,02	USD 700.000	DBUBS 2017-BRKB Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	564.123	0,06
USD 4.783	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-29 5,969% 25/2/2035	4.244	0,00	USD 852.000	Edison International 6,95% 15/11/2029	897.175	0,10
USD 708.000	Citigroup 0,776% 30/10/2024	701.571	0,08	USD 252.000	Elevance Health 3,6% 15/3/2051	185.161	0,02
GBP 200.000	Citigroup 1,75% 23/10/2026	224.222	0,02	USD 484.000	Elevance Health 5,125% 15/2/2053	455.915	0,05
USD 135.000	Citigroup 2,561% 1/5/2032	108.783	0,01	EUR 200.000	Encore Capital 4,875% 15/10/2025*	207.527	0,02
USD 136.000	Citigroup 2,572% 3/6/2031	112.403	0,01	USD 594.000	Entergy Louisiana 2,35% 15/6/2032	472.264	0,05
USD 210.000	Citigroup 2,666% 29/1/2031	176.064	0,02	USD 232.000	Entergy Louisiana 4% 15/3/2033	208.198	0,02
USD 130.000	Citigroup 2,976% 5/11/2030	111.673	0,01	USD 840.000	Equinix 3,9% 15/4/2032	748.325	0,09
USD 278.000	Citigroup 3,057% 25/1/2033	229.444	0,03	USD 470.000	Eversource Energy 1,65% 15/8/2030	370.282	0,04
USD 246.000	Citigroup 3,785% 17/3/2033	213.982	0,02	USD 226.000	Eversource Energy 3,375% 1/3/2032	193.622	0,02
USD 124.000	Citigroup 3,98% 20/3/2030	113.983	0,01	USD 338.000	Eversource Energy 5,125% 15/5/2033	327.131	0,04
USD 289.000	Citigroup 4,412% 31/3/2031	268.305	0,03	USD 977.000	Exelon 4,7% 15/4/2050	831.347	0,09
USD 941.000	Citigroup 4,91% 24/5/2033	896.633	0,10	USD 635.418	Fannie Mae Pool 1,5% 1/11/2041	511.027	0,06
USD 685.000	Citigroup 6,27% 17/11/2033	714.085	0,08	USD 1.440.897	Fannie Mae Pool 1,5% 1/12/2041	1.158.842	0,13
USD 387.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 4,023% 11/3/2047	384.325	0,04	USD 201.223	Fannie Mae Pool 1,5% 1/11/2050	152.304	0,02
USD 204.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C2 3,176% 10/8/2049	176.869	0,02	USD 269.940	Fannie Mae Pool 1,5% 1/3/2051	204.359	0,02
USD 915.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5 4,408% 10/6/2051	837.305	0,09	USD 240.277	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2031	215.736	0,02
USD 226.549	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-FX1 7,275% 25/10/2036	131.989	0,01	USD 135.333	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2037	119.065	0,01
USD 468.921	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A5 6% 25/5/2037	409.917	0,04	USD 758.909	Fannie Mae Pool 2% 1/6/2041	632.395	0,07
USD 712.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	636.857	0,07	USD 885.734	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2042	736.982	0,08
USD 618.000	Comcast 1,5% 15/2/2031	483.720	0,05	USD 113.891	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2042	94.772	0,01
USD 276.000	Comcast 3,4% 15/7/2046	201.978	0,02	USD 1.880.321	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2042	1.565.760	0,17
USD 1.179.000	Comcast 3,969% 1/11/2047	946.051	0,10	USD 171.973	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2050	137.982	0,02
USD 716.000	Comcast 4,25% 15/11/2033*	672.216	0,07	USD 309.797	Fannie Mae Pool 2% 1/10/2050	248.861	0,03
USD 1.837.717	COMM 2015-CCRE27 Mortgage Trust 4,486% 10/10/2048	1.667.618	0,18	USD 92.592	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2050	74.962	0,01
USD 635.000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3,829% 10/2/2048	578.721	0,06	USD 295.713	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2050	238.968	0,03
USD 584.000	Commonwealth Edison 5,3% 1/2/2053	572.903	0,06	USD 321.632	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2051	257.873	0,03
EUR 200.000	Coty 3,875% 15/4/2026*	211.072	0,02	USD 248.985	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2051	199.456	0,02
USD 170.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	146.366	0,02	USD 193.594	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2051	156.442	0,02
USD 1.095.000	Credit Suisse USA 7,125% 15/7/2032	1.220.012	0,13	USD 108.997	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2051	88.238	0,01
USD 122.000	Crown Castle 2,5% 15/7/2031	98.489	0,01	USD 97.802	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	79.312	0,01
USD 148.000	Crown Castle 3,1% 15/11/2029	128.767	0,01	USD 147.755	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	119.402	0,01
USD 872.000	Crown Castle 3,3% 1/7/2030	757.972	0,08	USD 171.216	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	138.604	0,02
USD 868.000	Crown Castle 5,1% 1/5/2033	835.307	0,09	USD 55.008	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	44.529	0,00
USD 351.000	CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust 3,708% 15/11/2048	282.743	0,03	USD 747.748	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2051	597.764	0,06
USD 220.000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 3,458% 15/11/2050	198.947	0,02	USD 349.228	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	282.458	0,03
USD 885.000	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust 5,064% 15/11/2051	793.374	0,09	USD 111.194	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	90.231	0,01
USD 544.000	CSX 4,1% 15/11/2032	510.919	0,06	USD 91.499	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	74.153	0,01
USD 307.000	CVS Health 4,3% 25/3/2028	295.009	0,03	USD 200.963	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	162.603	0,02
USD 1.279.000	CVS Health 5,125% 20/7/2045	1.139.570	0,12	USD 313.937	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	250.833	0,03
				USD 67.599	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	54.000	0,01
				USD 126.186	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	101.946	0,01
				USD 55.689	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	45.720	0,01
				USD 81.680	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	65.242	0,01
				USD 187.522	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	151.378	0,02
				USD 280.872	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	225.559	0,02
				USD 281.226	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	226.619	0,02
				USD 255.530	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	206.734	0,02
				USD 259.728	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	209.838	0,02
				USD 223.413	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	180.495	0,02
				USD 346.777	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	283.397	0,03
				USD 67.915	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	54.379	0,01
				USD 131.267	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	106.191	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 303.495	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	245.190	0,03	USD 130.973	Fannie Mae Pool 3,5% 1/2/2048	119.025	0,01
USD 677.009	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	545.251	0,06	USD 13.459	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	13.004	0,00
USD 158.640	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	128.165	0,01	USD 38.172	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2033	37.002	0,00
USD 286.827	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	231.238	0,03	USD 119.527	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2045	113.480	0,01
USD 524.415	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	422.251	0,05	USD 140.771	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2050	132.044	0,01
USD 200.860	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	162.131	0,02	USD 36.118	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2050	33.599	0,00
USD 540.356	Fannie Mae Pool 2,5% 1/6/2031	498.061	0,05	USD 92.395	Fannie Mae Pool 4,5% 1/8/2042	90.035	0,01
USD 235.913	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2050	200.340	0,02	USD 31.870	Fannie Mae Pool 4,5% 1/1/2043	31.056	0,00
USD 359.563	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2050	302.733	0,03	USD 79.422	Fannie Mae Pool 4,5% 1/8/2045	76.903	0,01
USD 353.619	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2050	297.740	0,03	USD 72.554	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2052	68.856	0,01
USD 362.235	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2050	305.006	0,03	USD 1.094.355	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2035	1.094.371	0,12
USD 470.631	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2050	396.242	0,04	USD 5.224	Fannie Mae Pool 5,5% 1/2/2035	5.279	0,00
USD 386.972	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2050	325.807	0,04	USD 383.638	Fannie Mae Pool 5,5% 1/8/2037	390.399	0,04
USD 120.758	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2050	101.668	0,01	USD 265.895	Fannie Mae Pool 5,5% 1/8/2037	270.731	0,03
USD 272.541	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2050	231.384	0,03	USD 354.728	Fannie Mae Pool 6% 1/5/2041	366.085	0,04
USD 67.375	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2051	56.687	0,01	USD 250.612	Fannie Mae-Aces 3,665% 25/9/2028	237.584	0,03
USD 708.703	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2051	600.281	0,06	USD 751.065	FBR Securitization Trust 6,134% 25/11/2035	729.874	0,08
USD 180.782	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2051	152.769	0,02	USD 1.500.000	Federal Farm Credit Banks Funding 2,1% 19/11/2040	974.036	0,11
USD 636.241	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2051	538.911	0,06	USD 1.130.000	Federal Home Loan Banks 2% 4/5/2035	826.283	0,09
USD 599.274	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	507.973	0,06	USD 1.230.000	Federal Home Loan Banks 2,125% 14/9/2029	1.081.549	0,12
USD 2.847.106	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	2.382.444	0,26	USD 500.000	Federal Home Loan Mortgage 4% 18/11/2024	490.180	0,05
USD 151.671	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	127.716	0,01	USD 2.423.000	Federal Home Loan Mortgage 6,25% 15/7/2032	2.771.914	0,30
USD 107.575	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	90.891	0,01	USD 492.000	FirstEnergy Transmission 4,55% 1/4/2049	399.753	0,04
USD 383.464	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	322.700	0,04	USD 2.000	FirstEnergy Transmission 5,45% 15/7/2044	1.821	0,00
USD 454.139	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	380.854	0,04	EUR 700.000	Fiserv 4,5% 24/5/2031	765.959	0,08
USD 73.772	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	62.486	0,01	USD 115.000	Fiserv 5,6% 2/3/2033	115.616	0,01
USD 33.699	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2029	31.676	0,00	USD 955.000	Florida Power & Light 3,15% 1/10/2049	668.447	0,07
USD 186.487	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2029	176.078	0,02	USD 155.000	Florida Power & Light 3,99% 1/3/2049	125.749	0,01
USD 188.301	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2029	177.712	0,02	USD 330.000	Florida Power & Light 4,8% 15/5/2033	322.272	0,04
USD 93.941	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2030	88.649	0,01	USD 456.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	435.227	0,05
USD 43.871	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2030	41.404	0,00	GBP 100.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	121.235	0,01
USD 2.169.355	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2047	1.910.877	0,21	EUR 100.000	Ford Motor Credit 6,125% 15/5/2028	111.410	0,01
USD 402.596	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2050	351.283	0,04	GBP 185.000	Ford Motor Credit 6,86% 5/6/2026	228.911	0,02
USD 391.127	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2051	339.012	0,04	USD 448.910	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/12/2027	428.365	0,05
USD 173.316	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2051	150.923	0,02	USD 538.624	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/12/2044	492.548	0,05
USD 669.328	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2052	582.135	0,06	USD 382.896	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/1/2045	351.209	0,04
USD 59.040	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2052	51.468	0,01	USD 346.700	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/6/2045	316.991	0,03
USD 93.106	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2052	80.630	0,01	USD 983.033	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/8/2044	935.303	0,10
USD 225.426	Fannie Mae Pool 3,5% 1/10/2030	215.871	0,02	USD 508.487	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2045	483.791	0,05
USD 5.751	Fannie Mae Pool 3,5% 1/11/2032	5.497	0,00	USD 290.577	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2045	276.359	0,03
USD 284.140	Fannie Mae Pool 3,5% 1/11/2047	258.213	0,03	USD 182.277	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/9/2039	177.856	0,02
USD 285.487	Fannie Mae Pool 3,5% 1/12/2047	259.425	0,03	USD 75.492	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/2/2040	73.276	0,01
USD 172.104	Fannie Mae Pool 3,5% 1/1/2048	156.605	0,02	USD 42.775	Freddie Mac Gold Pool 5% 1/10/2036	42.382	0,00

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 505	Freddie Mac Gold Pool 6,5% 1/8/2032	519	0,00	USD 1.265.000	FREMF 2018-K72 Mortgage Trust 4,119% 25/12/2050	1.176.252	0,13
USD 88.897	Freddie Mac Pool 1,5% 1/8/2050	67.444	0,01	USD 875.000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7,894% 17/8/2037	879.377	0,10
USD 221.894	Freddie Mac Pool 1,5% 1/10/2050	168.193	0,02	USD 288.000	Gen Digital 6,75% 30/9/2027	288.152	0,03
USD 101.993	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2036	90.105	0,01	USD 839.000	General Motors 5% 1/10/2028	813.524	0,09
USD 125.530	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2042	104.422	0,01	USD 431.000	General Motors 5,4% 15/10/2029	416.144	0,05
USD 58.280	Freddie Mac Pool 2% 1/8/2050	47.088	0,01	USD 229.000	General Motors Financial 6,05% 10/10/2025	229.171	0,02
USD 90.952	Freddie Mac Pool 2% 1/11/2050	73.621	0,01	USD 932.000	Gilead Sciences 2,8% 1/10/2050	602.218	0,07
USD 550.674	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2051	440.985	0,05	USD 375.000	Gilead Sciences 4,75% 1/3/2046	341.610	0,04
USD 280.452	Freddie Mac Pool 2% 1/4/2051	227.434	0,02	USD 807	Ginnie Mae I Pool 6,5% 15/4/2031	819	0,00
USD 163.855	Freddie Mac Pool 2% 1/5/2051	132.653	0,01	USD 2.504	Ginnie Mae I Pool 6,5% 15/7/2031	2.539	0,00
USD 755.590	Freddie Mac Pool 2% 1/7/2051	616.303	0,07	USD 1.021.508	Ginnie Mae II Pool 2% 20/8/2050	849.372	0,09
USD 47.249	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2051	38.185	0,00	USD 129.313	Ginnie Mae II Pool 2% 20/11/2050	107.441	0,01
USD 221.251	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2051	177.830	0,02	USD 587.169	Ginnie Mae II Pool 2% 20/1/2051	487.028	0,05
USD 45.281	Freddie Mac Pool 2% 1/10/2051	36.218	0,00	USD 269.844	Ginnie Mae II Pool 2% 20/2/2051	223.961	0,02
USD 599.318	Freddie Mac Pool 2% 1/10/2051	479.557	0,05	USD 384.144	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/4/2051	327.961	0,04
USD 73.297	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	59.138	0,01	USD 512.345	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/10/2051	437.409	0,05
USD 157.209	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	126.996	0,01	USD 356.787	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/12/2051	304.561	0,03
USD 195.163	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	157.893	0,02	USD 295.899	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/7/2052	252.545	0,03
USD 30.224	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	24.690	0,00	USD 661.210	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2044	595.467	0,06
USD 463.560	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	375.029	0,04	USD 93.972	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2050	83.464	0,01
USD 340.299	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	278.133	0,03	USD 117.955	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2050	104.716	0,01
USD 1.439.289	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	1.158.606	0,13	USD 548.222	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2051	483.914	0,05
USD 243.814	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	196.995	0,02	USD 173.813	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2051	153.333	0,02
USD 82.915	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2052	66.304	0,01	USD 107.550	Ginnie Mae II Pool 3% 20/1/2052	94.675	0,01
USD 65.544	Freddie Mac Pool 2,5% 1/7/2050	55.118	0,01	USD 987.683	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/11/2046	912.506	0,10
USD 556.969	Freddie Mac Pool 2,5% 1/2/2051	472.871	0,05	USD 707.727	Ginnie Mae II Pool 4% 20/6/2047	670.065	0,07
USD 322.026	Freddie Mac Pool 2,5% 1/5/2051	274.088	0,03	USD 601.121	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/5/2041	587.957	0,06
USD 480.530	Freddie Mac Pool 2,5% 1/5/2051	404.138	0,04	USD 45.782	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/9/2048	44.172	0,00
USD 317.598	Freddie Mac Pool 2,5% 1/11/2051	267.400	0,03	USD 17.606	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/4/2050	17.027	0,00
USD 232.688	Freddie Mac Pool 2,5% 1/12/2051	195.100	0,02	USD 243.579	Ginnie Mae II Pool 5% 20/7/2040	242.795	0,03
USD 670.461	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	586.683	0,06	USD 140.000	Global Payments 2,15% 15/1/2027	124.755	0,01
USD 135.634	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	117.731	0,01	EUR 1.547.000	Global Payments 4,875% 17/3/2031	1.678.899	0,18
USD 352.750	Freddie Mac Pool 3% 1/9/2050	312.887	0,03	USD 340.000	Goldman Sachs 1,992% 27/1/2032	265.003	0,03
USD 89.848	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2051	78.554	0,01	USD 2.152.000	Goldman Sachs 2,383% 21/7/2032	1.701.362	0,18
USD 115.256	Freddie Mac Pool 3% 1/10/2051	100.327	0,01	USD 306.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	247.847	0,02
USD 66.280	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	57.951	0,01	USD 160.000	Goldman Sachs 2,65% 21/10/2032	128.471	0,01
USD 651.223	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2052	566.428	0,06				
USD 76.876	Freddie Mac Pool 3,5% 1/1/2034	73.066	0,01				
USD 2.142.970	Freddie Mac Pool 3,5% 1/9/2046	1.954.469	0,21				
USD 172.110	Freddie Mac Pool 3,5% 1/1/2048	156.469	0,02				
USD 543.179	Freddie Mac Pool 4% 1/1/2045	516.150	0,06				
USD 9.731	Freddie Mac Pool 4% 1/7/2048	9.153	0,00				
USD 68.414	Freddie Mac Pool 4,5% 1/7/2052	64.913	0,01				
USD 421.558	Freddie Mac Pool 4,5% 1/7/2052	399.971	0,04				
USD 134.310	Freddie Mac Pool 4,5% 1/8/2052	127.454	0,01				
USD 20.000	Freedom Mortgage 8,25% 15/4/2025	19.705	0,00				

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 211.000	Goldman Sachs 3,102% 24/2/2033	175.814	0,02	USD 124.000	Lowe's 5,125% 15/4/2050	113.154	0,01
GBP 791.000	Goldman Sachs 3,625% 29/10/2029	885.765	0,10	USD 169.000	Lowe's 5,625% 15/4/2053	164.584	0,02
EUR 3.536.000	Goldman Sachs 4% 21/9/2029*	3.776.998	0,41	USD 170.000	Marsh & McLennan 5,45% 15/3/2053	168.192	0,02
GBP 100.000	Goldman Sachs 7,25% 10/4/2028*	131.892	0,01	USD 216.000	Marsh & McLennan 6,25% 1/11/2052	237.213	0,03
USD 415.237	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2,31% 20/10/2048	320.680	0,03	USD 977.438	Mastr Asset Backed Trust 2004-OPT2 6,129% 25/9/2034	833.858	0,09
USD 1.562.228	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-3 4,95% 20/7/2049	1.420.096	0,15	USD 312.324	Mastr Asset Backed Trust 2005-WF1 7,154% 25/6/2035	313.781	0,03
USD 1.260.000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5,515% 3/5/2032	1.228.088	0,13	USD 398.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	391.485	0,04
USD 1.564.363	GS Mortgage Trust 2015-GC34 4,466% 10/10/2048	1.424.514	0,15	USD 76.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	66.232	0,01
USD 1.162.000	GS Mortgage Trust 2016-GS2 3,759% 10/5/2049	1.037.005	0,11	EUR 100.000	Metropolitan Life Global Funding I 0,375% 9/4/2024	106.124	0,01
USD 740.845	GSMPPS Mortgage Loan Trust 2005-RP1 3,843% 25/1/2035	632.753	0,07	USD 853.000	MF1 2022-FL10 7,949% 17/9/2037	856.115	0,09
USD 525.238	GSMPPS Mortgage Loan Trust 2005-RP3 3,816% 25/9/2035	479.985	0,05	USD 286.000	Moody's 3,1% 29/11/2061	181.624	0,02
USD 123.000	HCA 2,375% 15/7/2031	97.104	0,01	USD 183.000	Moody's 3,75% 25/2/2052	140.167	0,01
USD 971.000	HCA 3,5% 1/9/2030	848.614	0,09	EUR 1.155.000	Morgan Stanley 0,497% 7/2/2031	984.005	0,11
USD 1.616.000	HCA 3,625% 15/3/2032	1.389.834	0,15	USD 2.356.000	Morgan Stanley 2,239% 21/7/2032	1.853.491	0,20
USD 739.000	HCA 5,5% 1/6/2033	724.576	0,08	USD 946.000	Morgan Stanley 2,511% 20/10/2032	753.077	0,08
USD 206.000	Home Depot 2,7% 15/4/2030	180.982	0,02	USD 167.000	Morgan Stanley 3,622% 1/4/2031	148.440	0,02
USD 700.000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3,982% 5/3/2037	634.731	0,07	USD 1.100.000	Morgan Stanley 4,431% 23/1/2030	1.042.850	0,11
USD 1.982.623	HSI Asset Securitization Trust 2007-NC1 5,569% 25/4/2037	1.277.873	0,14	EUR 1.130.000	Morgan Stanley 4,656% 2/3/2029	1.239.425	0,13
USD 1.534.500	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3,763% 10/7/2035	1.440.583	0,16	USD 3.307.000	Morgan Stanley 4,889% 20/7/2033	3.132.693	0,34
USD 579.666	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 5,669% 25/7/2036	565.232	0,06	USD 377.000	Morgan Stanley 5,164% 20/4/2029	369.561	0,04
USD 960.000	Intel 5,2% 10/2/2033	959.207	0,10	USD 281.000	Morgan Stanley 5,25% 21/4/2034	272.690	0,03
USD 4.906.819	IXIS Real Estate Capital Trust 2006-HE2 5,949% 25/8/2036	1.448.026	0,16	USD 40.000	Morgan Stanley 5,424% 21/7/2034	39.361	0,00
USD 690.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4,881% 15/1/2049	580.195	0,06	USD 415.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	412.114	0,05
USD 541.264	JP Morgan Mortgage Trust 2017-2 3,649% 25/5/2047	473.861	0,05	USD 378.000	Morgan Stanley 6,342% 18/10/2033	396.649	0,04
USD 845.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4,359% 17/3/2049	692.473	0,07	USD 555.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 3,994% 15/12/2049	502.769	0,05
USD 1.000.000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C2 3,144% 15/6/2049	925.366	0,10	USD 1.000.000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 3,89% 15/12/2050	898.843	0,10
EUR 576.000	JPMorgan Chase 0,625% 25/1/2024	616.873	0,07	USD 852.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E 3,912% 9/9/2032	674.247	0,07
GBP 200.000	JPMorgan Chase 0,991% 28/4/2026	233.997	0,03	USD 1.449.748	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 4,62% 15/7/2051	1.238.952	0,13
USD 139.000	JPMorgan Chase 2,545% 8/11/2032	112.260	0,01	USD 289.971	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 4,869% 15/10/2051	253.978	0,03
USD 2.411.000	JPMorgan Chase 2,963% 25/1/2033	2.005.080	0,22	USD 634.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	547.278	0,06
USD 1.591.000	JPMorgan Chase 4,565% 14/6/2030	1.519.610	0,16	USD 120.253	Mosaic Solar Loan Trust 2020-1 3,1% 20/4/2046	99.414	0,01
USD 464.000	JPMorgan Chase 4,912% 25/7/2033	446.368	0,05	USD 320.633	Mosaic Solar Loan Trust 2020-2 1,44% 20/8/2046	260.002	0,03
USD 423.000	JPMorgan Chase 5,35% 1/6/2034	418.773	0,05	USD 194.482	Mosaic Solar Loan Trust 2020-2 2,21% 20/8/2046	157.599	0,02
USD 281.000	KLA 5,25% 15/7/2062	273.285	0,03	USD 216.548	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4,38% 21/1/2053	201.309	0,02
GBP 100.000	Kraft Heinz Foods 4,125% 1/7/2027	119.914	0,01	EUR 1.070.000	Nasdaq 4,5% 15/2/2032*	1.181.184	0,13
EUR 100.000	Liberty Mutual 3,625% 23/5/2059	103.562	0,01	USD 173.000	Nasdaq 5,55% 15/2/2034	172.532	0,02
USD 682.000	Lowe's 4,25% 1/4/2052	540.519	0,06	USD 235.000	Nasdaq 6,1% 28/6/2063	231.615	0,03
				USD 630.619	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-C 7,025% 15/11/2068	632.361	0,07
				USD 539.459	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 6,149% 25/10/2035	518.933	0,06

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 140.000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 3% 1/7/2051	94.766	0,01	EUR 914.000	Procter & Gamble 3,25% 2/8/2026	984.446	0,11
GBP 150.000	New York Life Global Funding 4,35% 16/9/2025	184.088	0,02	USD 624.000	Prologis 5,125% 15/1/2034	614.463	0,07
USD 843.443	Newcastle Mortgage Trust 2007-1 5,659% 25/4/2037	817.158	0,09	USD 209.000	Public Service Electric and Gas 3,1% 15/3/2032	181.427	0,02
USD 1.851.000	NextEra Energy Capital 2,25% 1/6/2030	1.523.013	0,16	USD 9.000	Public Service Electric and Gas 3,6% 1/12/2047	6.881	0,00
USD 352.000	NextEra Energy Capital 2,75% 1/11/2029	304.350	0,03	USD 914.000	Public Service Electric and Gas 3,7% 1/5/2028	866.826	0,09
USD 223.000	NextEra Energy Capital 5,05% 28/2/2033	216.186	0,02	USD 475.000	Public Service Electric and Gas 4,65% 15/3/2033	460.627	0,05
USD 425.000	NextEra Energy Capital 5,749% 1/9/2025	426.215	0,05	USD 490.000	Public Service Electric and Gas 4,9% 15/12/2032	484.337	0,05
USD 454.000	Norfolk Southern 2,3% 15/5/2031	374.769	0,04	USD 1.059.000	QUALCOMM 2,15% 20/5/2030	900.620	0,10
USD 656.000	Norfolk Southern 3% 15/3/2032	559.000	0,06	USD 190.000	QUALCOMM 4,5% 20/5/2052	166.079	0,02
USD 254.000	NVIDIA 2% 15/6/2031	210.397	0,02	USD 467.577	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 7,782% 25/6/2037	468.475	0,05
USD 1.010.000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 3,566% 10/5/2039	868.504	0,09	USD 198.451	Renaissance Home Equity Loan Trust 2005-3 5,14% 25/11/2035	194.247	0,02
USD 690.000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 4,077% 10/5/2039	502.063	0,05	USD 313.000	Republic Services 2,375% 15/3/2033	248.962	0,03
EUR 100.000	Olympus Water US 9,625% 15/11/2028	108.679	0,01	USD 1.052.000	Ryder System 5,25% 1/6/2028	1.038.244	0,11
USD 159.000	Oncor Electric Delivery 3,1% 15/9/2049	108.177	0,01	USD 173.000	S&P Global 3,9% 1/3/2062	135.970	0,01
USD 37.000	Oncor Electric Delivery 3,8% 30/9/2047	29.038	0,00	USD 269.000	Salesforce 1,95% 15/7/2031	219.307	0,03
USD 949.000	Oncor Electric Delivery 4,15% 1/6/2032	889.589	0,10	USD 2.425.000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052	2.611.790	0,28
USD 551.000	Oncor Electric Delivery 4,55% 15/9/2032	524.924	0,06	USD 299.000	San Diego Gas & Electric 1,7% 1/10/2030	238.296	0,03
USD 1.162.000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3,14% 14/10/2036	1.066.477	0,12	USD 415.000	San Diego Gas & Electric 3% 15/3/2032	353.412	0,04
USD 194.494	OneMain Financial Issuance Trust 2020-A 3,84% 14/5/2032	194.021	0,02	USD 499.200	Sesac Finance 5,216% 25/7/2049	473.164	0,05
USD 150.000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2,22% 16/6/2036	125.617	0,01	USD 168.000	Sherwin-Williams 2,9% 15/3/2052	105.785	0,01
USD 170.000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2,47% 16/6/2036	137.239	0,02	USD 404.178	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-A 5,952% 15/6/2033	398.938	0,04
USD 132.000	Oracle 1,65% 25/3/2026	120.223	0,01	USD 1.485.737	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 5,882% 15/6/2039	1.440.231	0,16
USD 1.158.000	Oracle 2,875% 25/3/2031	978.706	0,11	USD 1.873.103	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 5,842% 15/6/2039	1.799.438	0,19
USD 2.621.000	Oracle 2,95% 1/4/2030	2.270.636	0,25	USD 384.625	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 5,752% 15/12/2039	369.207	0,04
EUR 200.000	Oracle 3,125% 10/7/2025*	214.322	0,02	USD 1.026.071	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10,175% 15/10/2041	1.085.865	0,12
USD 200.000	Oracle 3,95% 25/3/2051	146.119	0,02	USD 680.000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 3,5% 15/9/2043	651.984	0,07
USD 230.000	Oracle 4,3% 8/7/2034	206.079	0,02	USD 885.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3% 15/8/2045	752.841	0,08
USD 169.000	Oracle 6,15% 9/11/2029	175.494	0,02	USD 1.595.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2,5% 15/9/2054	1.262.515	0,14
USD 739.000	Oracle 6,25% 9/11/2032	773.042	0,08	USD 1.090.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2,5% 15/9/2054	869.474	0,09
EUR 100.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2,875% 30/4/2028	96.544	0,01	USD 1.721.854	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 6,155% 15/1/2053	1.695.776	0,18
USD 450.000	Pacific Gas and Electric 4,55% 1/7/2030	404.749	0,04	USD 1.850.136	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 6,639% 16/2/2055	1.842.978	0,20
USD 755.000	Pacific Gas and Electric 4,95% 1/7/2050	586.294	0,06	USD 1.473.998	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4,48% 16/5/2050	1.413.993	0,15
USD 204.000	PECO Energy 2,85% 15/9/2051	129.302	0,01				
USD 490.000	PECO Energy 4,375% 15/8/2052	418.597	0,05				
USD 104.000	PECO Energy 4,6% 15/5/2052	91.430	0,01				
USD 31.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	29.862	0,00				
USD 200.000	Periama 5,95% 19/4/2026*	190.752	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 182.000	SoFi Professional Loan Program 2017-D 3,61% 25/9/2040	163.342	0,02	USD 596.000	Verizon Communications 1,68% 30/10/2030	465.661	0,05
USD 292.000	SoFi Professional Loan Program 2017-E 4,16% 26/11/2040	264.993	0,03	USD 108.000	Verizon Communications 2,355% 15/3/2032	85.432	0,01
USD 414.213	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2,84% 25/1/2041	398.673	0,04	USD 389.000	Verizon Communications 3,7% 22/3/2061	265.562	0,03
USD 314.000	Southern California Edison 2,5% 1/6/2031	258.546	0,03	USD 1.486.000	Verizon Communications 4,329% 21/9/2028	1.422.442	0,15
USD 1.188.000	Southern California Edison 2,75% 1/2/2032	982.789	0,11	USD 1.047.000	Verizon Communications 4,4% 1/11/2034	948.085	0,10
USD 1.224.000	Southern California Edison 5,95% 1/11/2032	1.269.537	0,14	USD 836.000	Walt Disney 2% 1/9/2029	709.386	0,08
USD 850.000	Sprint Capital 8,75% 15/3/2032	1.012.711	0,11	USD 237.000	Walt Disney 3,8% 22/3/2030	221.990	0,02
USD 235.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	227.892	0,03	USD 1.312.600	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR11 Trust 5,39% 25/9/2046	1.044.384	0,11
USD 130.000	Texas Instruments 4,9% 14/3/2033	130.552	0,02	USD 2.408.636	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR13 Trust 5,31% 25/10/2046	2.016.898	0,22
USD 692.000	Thermo Fisher Scientific 1,75% 15/10/2028	595.288	0,06	USD 1.510.052	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 5,228% 25/6/2047	1.163.229	0,13
USD 475.000	Thermo Fisher Scientific 2,6% 1/10/2029	416.088	0,05	USD 2.187.190	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-AR8 Trust 5,28% 25/10/2046	1.821.330	0,20
USD 136.000	Time Warner Cable 6,55% 1/5/2037	129.213	0,01	EUR 803.000	Wells Fargo 1,625% 2/6/2025	835.535	0,09
USD 2.379.000	T-Mobile USA 3,875% 15/4/2030	2.169.806	0,23	EUR 530.000	Wells Fargo 2,125% 4/6/2024	566.232	0,06
USD 932.000	T-Mobile USA 5,05% 15/7/2033	899.201	0,10	USD 1.207.000	Wells Fargo 3,35% 2/3/2033*	1.016.002	0,11
USD 1.386.421	Tricon American Homes 2019-SFR1 Trust 2,75% 17/3/2038	1.291.508	0,14	USD 106.000	Wells Fargo 5,389% 24/4/2034	103.301	0,01
USD 186.000	Union Pacific 3,799% 6/4/2071	137.361	0,01	USD 1.717.000	Wells Fargo 5,557% 25/7/2034	1.695.918	0,18
USD 919.000	Union Pacific 3,839% 20/3/2060	707.322	0,08	USD 255.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC24 3,621% 15/10/2049	220.217	0,02
USD 95.677	United Airlines 2016-1 Class AA Pass Through Trust 3,1% 7/7/2028	87.644	0,01	USD 257.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 3,903% 15/7/2050	213.159	0,02
USD 588.248	United Airlines 2018-1 Class AA Pass Through Trust 3,5% 1/3/2030	533.539	0,06	USD 1.390.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3,874% 15/6/2036	1.175.721	0,13
USD 4.745.000	United States Treasury Bill 0% 15/2/2024	4.628.537	0,50	USD 413.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 4,556% 16/6/2051	351.494	0,04
USD 4.800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/4/2026	5.234	0,00	USD 440.000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 3,891% 15/8/2047	419.163	0,05
USD 2.600.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/10/2026	2.712.998	0,29	USD 313.352	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-1 3,919% 20/6/2044	290.983	0,03
USD 3.900.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125% 15/1/2031†	4.003.795	0,43			296.754.147	32,07
USD 61.600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	56.898	0,01	Uruguay			
USD 111.000	United States Treasury Note/ Bond 1,125% 15/2/2031	90.116	0,01	USD 200.000	Uruguay Government International Bond 4,375% 27/10/2027*	199.571	0,02
USD 640.000	United States Treasury Note/ Bond 1,375% 15/11/2040†	408.750	0,04	USD 199.847	Uruguay Government International Bond 5,1% 18/6/2050*	192.565	0,02
USD 1.640.000	United States Treasury Note/ Bond 3,625% 15/2/2053†	1.478.562	0,16			392.136	0,04
USD 765.000	UnitedHealth 2,875% 15/8/2029	686.723	0,07	Total des obligations			
USD 388.000	UnitedHealth 3,875% 15/12/2028	371.466	0,04			884.436.858	95,58
USD 1.674.000	UnitedHealth 5,3% 15/2/2030	1.708.087	0,19	BILLET DE TRÉSORERIE			
GBP 100.000	Verizon Communications 1,125% 3/11/2028*	100.340	0,01	Australie			
USD 2.664.000	Verizon Communications 1,45% 20/3/2026	2.416.401	0,26	USD 1.000.000	Macquarie Bank 0% 12/2/2024	973.961	0,11
USD 692.000	Verizon Communications 1,5% 18/9/2030	540.703	0,06	USD 1.395.000	Macquarie Bank 0% 20/8/2024	1.317.486	0,14
						2.291.447	0,25
				France			
				USD 955.000	Societe Generale 0% 24/4/2024	919.075	0,10

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net		
USD 1.000.000	Allemagne Bayer 0% 12/8/2024	943.082	0,10	USD 955.000	France Natixis (New York Branch) 5,97% 20/5/2024	955.045	0,10		
USD 975.000	Japon MUFG Bank (New York Branch) 0% 22/11/2023	962.624	0,10	USD 2.000.000	Japon Mizuho Bank 5,5% 22/11/2023	2.000.084	0,22		
USD 1.395.000	Royaume-Uni NatWest Markets 0% 20/5/2024	1.336.648	0,15	USD 1.405.000	États-Unis Citibank (New York Branch) 5,89% 10/5/2024	1.404.969	0,15		
USD 2.000.000	États-Unis HSBC USA 0% 22/8/2024	1.879.235	0,20	Total des certificats de dépôt		5.754.935	0,62		
Total des billets de trésorerie		8.332.111	0,90	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		898.523.904	97,10		
CERTIFICATS DE DÉPÔT				Total du portefeuille				898.523.904	97,10
USD 1.395.000	Canada Toronto Dominion Bank (New York Branch) 5,93% 15/8/2024	1.394.837	0,15	Autres éléments de l'actif net				26.802.213	2,90
				Total de l'actif net (USD)				925.326.117	100,00

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	190.000	NZD	208.883	Deutsche Bank	20/9/2023	(1.093)
AUD	230.000	USD	158.426	Morgan Stanley	20/9/2023	(9.355)
BRL	17.187.797	USD	3.461.815	Citigroup	14/9/2023	21.120
BRL	2.780.000	USD	554.649	HSBC Bank	20/9/2023	8.139
BRL	17.687.078	USD	3.581.649	Citigroup	20/9/2023	(1.046)
BRL	20.000.000	USD	4.148.840	BNY Mellon	20/9/2023	(100.004)
BRL	1.461.000	USD	298.578	Barclays	14/9/2023	(2.521)
CAD	2.893.580	USD	2.180.000	HSBC Bank	20/9/2023	(40.608)
CAD	160.000	USD	121.639	Bank of America	20/9/2023	(3.341)
CAD	5.965.000	EUR	4.086.862	Morgan Stanley	5/9/2023	(24.983)
CHF	600.654	USD	670.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	11.264
CLP	390.442.000	USD	450.337	BNP Paribas	14/9/2023	6.088
CLP	259.288.000	USD	300.380	JP Morgan	14/9/2023	2.726
CLP	259.288.000	USD	299.616	Toronto-Dominion	14/9/2023	3.490
CNH	5.390.000	USD	762.937	Citigroup	14/9/2023	(21.696)
CNH	20.853.698	USD	2.934.540	HSBC Bank	20/9/2023	(65.819)
CNH	11.590.000	USD	1.608.870	JP Morgan	14/9/2023	(14.996)
COP	4.462.308.000	USD	1.095.605	Standard Chartered Bank	14/9/2023	(12.523)
COP	3.096.026.000	USD	705.406	BNP Paribas	17/5/2024	7.575
COP	1.225.885.000	USD	297.906	Bank of America	14/9/2023	(362)
COP	2.486.787.000	USD	598.217	Toronto-Dominion	29/9/2023	2.344
COP	1.244.692.000	USD	301.524	Citigroup	14/9/2023	585
CZK	52.835.000	USD	2.391.515	Morgan Stanley	20/9/2023	(10.164)
CZK	29.607.069	USD	1.339.200	Barclays	14/9/2023	(4.448)
CZK	87.738.171	USD	3.967.744	BNP Paribas	20/9/2023	(13.255)
CZK	60.255.233	USD	2.765.655	Morgan Stanley	14/9/2023	(49.216)
EUR	19.150.000	JPY	2.863.491.074	JP Morgan	20/9/2023	1.150.394
EUR	16.339.500	USD	17.723.554	UBS	20/9/2023	17.646
EUR	1.800.000	GBP	1.545.381	UBS	20/9/2023	(4.730)
EUR	3.200.000	USD	3.499.995	JP Morgan	20/9/2023	(25.480)
EUR	2.140.000	GBP	1.843.394	Bank of America	20/9/2023	(13.366)
EUR	2.510.000	USD	2.746.588	HSBC Bank	20/9/2023	(21.267)
EUR	1.940.000	USD	2.121.462	Deutsche Bank	20/9/2023	(15.037)
EUR	360.000	USD	393.934	Société Générale	20/9/2023	(3.051)

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	720.000	GBP	617.083	HSBC Bank	20/9/2023	(537)
EUR	34.611	NOK	400.000	Goldman Sachs	20/9/2023	(2)
EUR	970.000	USD	1.067.034	Citigroup	20/9/2023	(13.822)
EUR	35.798	NOK	400.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.288
EUR	1.462.000	USD	1.624.289	Barclays	14/9/2023	(37.331)
EUR	11.260.000	USD	12.502.328	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(276.379)
EUR	675.048	AUD	1.110.000	State Street	5/9/2023	13.395
EUR	110.000	USD	121.688	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.251)
EUR	35.506	HUF	14.000.000	Société Générale	20/9/2023	(1.257)
EUR	70.000	USD	77.014	Bank of America	20/9/2023	(1.009)
EUR	41.273	HUF	16.000.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(681)
GBP	12.884.935	EUR	14.970.000	Standard Chartered Bank	20/9/2023	80.561
GBP	2.467.913	EUR	2.870.000	HSBC Bank	20/9/2023	12.470
GBP	120.000	USD	153.956	Deutsche Bank	20/9/2023	(1.827)
GBP	612.372	EUR	710.000	Deutsche Bank	20/9/2023	5.422
GBP	30.000	USD	38.812	Barclays	20/9/2023	(780)
GBP	60.000	USD	76.970	Morgan Stanley	20/9/2023	(905)
GBP	100.000	USD	128.673	HSBC Bank	20/9/2023	(1.899)
GBP	4.100.000	EUR	4.774.819	JP Morgan	5/9/2023	16.721
GBP	931.396	EUR	1.080.000	Bank of America	20/9/2023	8.122
HUF	763.759.180	USD	2.166.140	JP Morgan	14/9/2023	8.274
HUF	42.000.000	EUR	107.913	Deutsche Bank	20/9/2023	2.254
HUF	14.000.000	EUR	35.884	JP Morgan	20/9/2023	846
HUF	15.000.000	EUR	37.713	BNP Paribas	20/9/2023	1.703
HUF	158.844.000	USD	449.868	Citigroup	14/9/2023	2.359
IDR	4.940.000.000	USD	330.922	Bank of America	20/9/2023	(6.629)
IDR	43.405.075.000	USD	2.911.181	State Street	20/9/2023	(61.802)
IDR	46.398.622.754	USD	3.123.229	UBS	20/9/2023	(77.334)
IDR	24.081.455.000	USD	1.606.501	JP Morgan	14/9/2023	(25.505)
IDR	6.900.000.000	USD	458.594	Barclays	20/9/2023	(5.635)
IDR	19.295.031.118	USD	1.258.563	Citigroup	20/9/2023	8.083
IDR	15.726.825.484	USD	1.027.964	HSBC Bank	14/9/2023	4.534
INR	100.400.000	USD	1.210.683	Barclays	20/9/2023	2.034
INR	364.144.000	USD	4.395.852	Citigroup	14/9/2023	2.651
INR	61.890.000	USD	749.364	BNP Paribas	14/9/2023	(1.794)
JPY	48.000.000	USD	336.786	Bank of America	20/9/2023	(7.525)
JPY	5.603.030.000	USD	40.675.377	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(2.240.826)
JPY	22.000.000	USD	158.100	BNP Paribas	20/9/2023	(7.189)
JPY	313.061.511	USD	2.230.633	JP Morgan	20/9/2023	(83.155)
JPY	5.570.000	USD	39.979	Morgan Stanley	20/9/2023	(1.771)
JPY	5.500.000	USD	39.834	BNY Mellon	20/9/2023	(2.106)
JPY	2.750.000	USD	20.024	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(1.160)
JPY	146.750.000	USD	1.038.316	Barclays	5/9/2023	(34.084)
JPY	1.863.845.000	EUR	11.926.433	Standard Chartered Bank	5/9/2023	(185.583)
JPY	40.000.000	USD	279.754	HSBC Bank	20/9/2023	(5.370)
JPY	20.000.000	USD	137.523	Barclays	20/9/2023	(330)
JPY	6.000.000	USD	41.463	Toronto-Dominion	20/9/2023	(305)
KRW	975.000.000	USD	771.782	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(34.011)
KRW	982.975.000	USD	753.604	Citigroup	14/9/2023	(9.841)
MXN	80.860.000	USD	4.571.633	State Street	20/9/2023	246.611
MXN	33.551.671	USD	1.902.391	JP Morgan	14/9/2023	98.954
MXN	68.396.000	USD	3.894.575	BNY Mellon	20/9/2023	180.970
MXN	112.885.002	USD	6.427.509	Royal Bank of Canada	20/9/2023	299.025
MXN	31.226	USD	1.814	State Street	14/9/2023	48
MYR	2.913.854	USD	645.373	Barclays	14/9/2023	(16.935)
NOK	10.300.723	USD	936.798	Deutsche Bank	14/9/2023	30.814
NOK	7.070.000	USD	672.477	HSBC Bank	20/9/2023	(8.221)
NOK	727.000	USD	69.626	Toronto-Dominion	20/9/2023	(1.319)

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
NOK	1.630.000	USD	155.697	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.551)
NOK	190.000	USD	18.121	Citigroup	20/9/2023	(270)
NOK	3.470.000	USD	335.243	Morgan Stanley	20/9/2023	(9.225)
NOK	820.000	USD	79.055	JP Morgan	20/9/2023	(2.013)
NOK	450.000	USD	42.354	State Street	20/9/2023	(75)
NOK	510.000	USD	48.458	Bank of America	20/9/2023	(543)
NOK	800.000	EUR	68.049	Goldman Sachs	20/9/2023	1.277
NOK	550.000	USD	52.291	Deutsche Bank	20/9/2023	(616)
NOK	160.000	USD	14.915	UBS	20/9/2023	118
NOK	210.000	USD	20.817	Barclays	20/9/2023	(1.086)
NOK	150.000	USD	14.915	BNY Mellon	20/9/2023	(821)
NOK	200.000	USD	19.705	Société Générale	20/9/2023	(914)
NOK	620.000	USD	58.595	BNP Paribas	20/9/2023	(343)
NZD	209.818	AUD	190.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.649
NZD	190.000	USD	118.471	Morgan Stanley	20/9/2023	(5.464)
NZD	190.000	USD	118.104	Toronto-Dominion	20/9/2023	(5.097)
NZD	70.000	USD	42.979	HSBC Bank	20/9/2023	(1.345)
PLN	4.740.000	USD	1.137.373	Bank of America	14/9/2023	12.733
SEK	770.000	USD	74.185	Citigroup	20/9/2023	(3.548)
SEK	3.620.000	USD	341.032	Morgan Stanley	20/9/2023	(8.942)
SEK	1.050.000	USD	98.942	Barclays	20/9/2023	(2.618)
SEK	1.010.000	USD	94.036	Deutsche Bank	20/9/2023	(1.380)
SEK	400.000	USD	36.726	Bank of America	20/9/2023	(31)
SEK	200.000	USD	18.482	Société Générale	20/9/2023	(135)
SEK	200.000	USD	18.529	BNY Mellon	20/9/2023	(181)
SEK	540.000	USD	52.006	State Street	20/9/2023	(2.469)
SEK	710.000	USD	67.747	Goldman Sachs	20/9/2023	(2.613)
SEK	1.600.000	USD	149.088	BNP Paribas	20/9/2023	(2.308)
SEK	120.000	USD	11.583	Toronto-Dominion	20/9/2023	(574)
SEK	220.000	USD	20.157	RBS	20/9/2023	26
SGD	1.318.314	USD	981.844	JP Morgan	14/9/2023	(6.111)
SGD	4.450.000	USD	3.332.095	JP Morgan	20/9/2023	(37.586)
THB	98.560.400	USD	2.853.515	HSBC Bank	14/9/2023	(36.117)
THB	55.039.000	USD	1.596.252	Citigroup	14/9/2023	(22.934)
THB	32.600.000	USD	940.497	Citigroup	20/9/2023	(8.056)
TRY	164.000	USD	5.973	Citigroup	5/9/2023	180
TWD	44.400.000	USD	1.463.041	State Street	20/9/2023	(68.620)
TWD	7.700.000	USD	247.780	Citigroup	20/9/2023	(5.954)
USD	2.195.570	IDR	32.757.355.000	Citigroup	20/9/2023	45.173
USD	253.048	TWD	7.700.000	Barclays	20/9/2023	11.223
USD	864.270	IDR	12.865.349.465	UBS	14/9/2023	19.633
USD	3.253.158	CZK	71.807.925	Deutsche Bank	14/9/2023	15.899
USD	6.166.562	MXN	109.048.863	JP Morgan	14/9/2023	(338.164)
USD	2.101.781	ZAR	40.562.747	State Street	14/9/2023	(55.059)
USD	2.641.951	BRL	13.113.954	BNP Paribas	14/9/2023	(15.460)
USD	187.707	SGD	251.229	State Street	14/9/2023	1.763
USD	1.110.710	IDR	16.538.252.266	State Street	14/9/2023	24.940
USD	466.638	INR	38.602.397	HSBC Bank	14/9/2023	359
USD	415.297	ZAR	7.850.192	Goldman Sachs	14/9/2023	(2.121)
USD	2.521.936	MXN	44.056.685	Citigroup	14/9/2023	(106.029)
USD	474.393	THB	16.272.156	Goldman Sachs	14/9/2023	9.245
USD	2.300.000	CNH	16.358.502	Société Générale	20/9/2023	49.656
USD	9.383.598	BRL	46.338.533	Citigroup	20/9/2023	2.744
USD	741.606	ZAR	13.895.000	HSBC Bank	20/9/2023	3.159
USD	3.118.441	MXN	54.625.680	JP Morgan	20/9/2023	(136.566)
USD	2.255.545	INR	186.290.000	Barclays	20/9/2023	5.376
USD	13.671.123	KRW	17.270.866.000	Standard Chartered Bank	20/9/2023	602.453
USD	229.569	GBP	180.000	JP Morgan	20/9/2023	1.375

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	6.983.291	EUR	6.435.000	State Street	20/9/2023	(3.741)
USD	16.353.912	IDR	242.953.394.516	UBS	20/9/2023	404.938
USD	12.110.743	EUR	11.165.000	UBS	20/9/2023	(12.057)
USD	14.939.782	GBP	11.840.000	State Street	20/9/2023	(70.287)
USD	3.601.299	MYR	16.530.000	Morgan Stanley	20/9/2023	34.699
USD	18.764.295	JPY	2.584.752.926	State Street	20/9/2023	1.033.921
USD	681.143	SEK	7.230.000	Bank of America	20/9/2023	17.878
USD	374.245	INR	30.811.600	Deutsche Bank	14/9/2023	2.071
USD	441.964	BRL	2.160.318	Barclays	14/9/2023	4.197
USD	1.200.196	THB	41.857.425	BNP Paribas	14/9/2023	3.681
USD	353.308	NOK	3.630.000	Morgan Stanley	20/9/2023	12.255
USD	75.174	SEK	808.000	Goldman Sachs	20/9/2023	1.050
USD	821.518	IDR	12.265.267.434	Barclays	14/9/2023	16.278
USD	40.738	SEK	440.000	RBS	20/9/2023	373
USD	38.336	GBP	30.000	Goldman Sachs	20/9/2023	303
USD	328.263	SEK	3.440.000	Morgan Stanley	20/9/2023	12.686
USD	18.960	SEK	200.000	Deutsche Bank	20/9/2023	612
USD	157.927	AUD	230.000	Bank of America	20/9/2023	8.857
USD	2.922.242	EUR	2.670.000	HSBC Bank	20/9/2023	23.194
USD	1.568.831	EUR	1.430.000	JP Morgan	20/9/2023	16.157
USD	87.217	NOK	920.000	JP Morgan	20/9/2023	779
USD	17.753	NOK	190.000	RBS	20/9/2023	(99)
USD	3.028.612	JPY	423.742.869	JP Morgan	20/9/2023	121.904
USD	77.644	SEK	820.000	JP Morgan	20/9/2023	2.419
USD	1.038.064	EUR	940.000	Morgan Stanley	20/9/2023	17.425
USD	2.916.062	ZAR	55.510.716	Citigroup	14/9/2023	(35.606)
USD	38.338	GBP	30.000	Bank of America	20/9/2023	305
USD	20.577	SEK	220.000	Citigroup	20/9/2023	394
USD	623.398	EUR	570.000	Société Générale	20/9/2023	4.500
USD	95.839	NOK	1.010.000	Barclays	20/9/2023	945
USD	4.398.637	EUR	4.030.000	Barclays	20/9/2023	22.920
USD	790.460	SGD	1.067.085	Citigroup	14/9/2023	670
USD	3.279.492	INR	269.771.003	Barclays	14/9/2023	20.922
USD	2.336.050	BRL	11.500.000	BNP Paribas	20/9/2023	7.970
USD	32.691	NOK	350.000	State Street	20/9/2023	(192)
USD	3.300.394	SGD	4.450.000	Barclays	20/9/2023	5.885
USD	1.393.660	EUR	1.270.000	Deutsche Bank	20/9/2023	14.713
USD	76.407	NOK	790.000	BNY Mellon	20/9/2023	2.183
USD	17.721	NOK	190.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(131)
USD	21.588	NOK	230.000	Bank of America	20/9/2023	(22)
USD	344.407	IDR	5.171.966.000	HSBC Bank	20/9/2023	4.887
USD	18.853	NOK	200.000	HSBC Bank	20/9/2023	62
USD	942.814	SGD	1.270.000	Morgan Stanley	20/9/2023	2.584
USD	166.083	GBP	130.000	Barclays	20/9/2023	1.276
USD	274.405	INR	22.600.000	Goldman Sachs	20/9/2023	1.423
USD	142.239	SEK	1.530.000	BNP Paribas	20/9/2023	1.881
USD	14.722	SEK	160.000	Barclays	20/9/2023	44
USD	199.657	NOK	2.050.000	Goldman Sachs	20/9/2023	7.050
USD	1.585.459	EUR	1.450.000	Citigroup	20/9/2023	11.069
USD	395.034	JPY	56.750.000	HSBC Bank	20/9/2023	5.754
USD	82.602	JPY	11.490.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	3.786
USD	1.410.613	MXN	24.400.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(43.322)
USD	77.710	NOK	800.000	Deutsche Bank	20/9/2023	2.546
USD	350.973	PHP	19.300.000	Deutsche Bank	20/9/2023	10.244
USD	43.799	JPY	6.000.000	BNP Paribas	20/9/2023	2.641
USD	36.184	JPY	5.000.000	Barclays	20/9/2023	1.886
USD	121.016	NZD	190.000	Morgan Stanley	20/9/2023	8.009
USD	3.325.912	EUR	2.960.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	111.986

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	99.747	SEK	1.060.000	State Street	20/9/2023	2.503
USD	1.905.303	EUR	1.690.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	70.324
USD	967.463	GBP	740.000	Toronto-Dominion	20/9/2023	29.333
USD	14.670	SEK	150.000	BNY Mellon	20/9/2023	909
USD	121.396	CAD	160.000	Morgan Stanley	20/9/2023	3.099
USD	1.022.585	NOK	10.300.723	Barclays	14/9/2023	54.973
USD	1.925.623	MXN	32.900.000	Citigroup	20/9/2023	(34.805)
USD	206.908	COP	830.840.000	BNY Mellon	20/9/2023	5.653
USD	2.642.475	CZK	58.033.019	Barclays	14/9/2023	26.219
USD	953.655	HUF	333.904.000	Bank of America	14/9/2023	3.034
USD	3.128.588	BRL	15.291.703	BNY Mellon	14/9/2023	29.879
USD	9.388.107	EUR	8.469.000	State Street	5/9/2023	199.261
USD	77.911	GBP	60.000	HSBC Bank	20/9/2023	1.846
USD	276.017	EUR	250.000	Morgan Stanley	5/9/2023	4.768
USD	5.304.014	GBP	4.120.915	BNY Mellon	5/9/2023	80.112
USD	4.276.597	JPY	604.845.528	UBS	5/9/2023	137.549
USD	7.960.440	CHF	6.906.000	RBS	5/9/2023	140.377
USD	19.246.823	MXN	324.152.232	Goldman Sachs	5/9/2023	(118.965)
USD	84.162.139	CNY	599.970.257	BNY Mellon	5/9/2023	1.833.487
USD	23.467.057	CAD	30.997.776	State Street	5/9/2023	553.890
USD	42.616.081	GBP	33.142.640	Standard Chartered Bank	5/9/2023	602.623
USD	7.643.861	CZK	165.858.171	Goldman Sachs	5/9/2023	163.943
USD	2.824.799	SGD	3.750.000	UBS	5/9/2023	50.417
USD	4.127.306	SEK	43.225.000	Morgan Stanley	5/9/2023	164.873
USD	386.412	RON	1.730.000	Barclays	5/9/2023	6.528
USD	877.220	AUD	1.306.099	State Street	5/9/2023	31.161
USD	492.329	HUF	173.790.000	RBS	5/9/2023	(3.371)
USD	43.390	NZD	70.000	HSBC Bank	20/9/2023	1.756
USD	1.950.343	DKK	13.151.000	Morgan Stanley	5/9/2023	35.525
USD	39.548.037	JPY	5.593.161.808	Deutsche Bank	5/9/2023	1.273.195
USD	64.419	JPY	9.110.000	Morgan Stanley	5/9/2023	2.078
USD	235.967.156	EUR	213.679.333	BNP Paribas	5/9/2023	4.125.557
USD	1.958.716	NOK	19.810.000	Morgan Stanley	5/9/2023	98.367
USD	1.402.753	CNH	10.000.000	UBS	5/9/2023	28.178
USD	3.935.572	PLN	15.740.000	Goldman Sachs	5/9/2023	114.541
USD	1.692.383	NZD	2.728.000	State Street	5/9/2023	69.901
USD	4.883.898	ZAR	86.983.274	UBS	5/9/2023	255.074
USD	1.799.177	THB	61.371.000	UBS	5/9/2023	46.423
USD	4.107.736	EUR	3.718.685	HSBC Bank	5/9/2023	72.971
USD	956.297	CNH	6.810.000	Barclays	5/9/2023	20.211
USD	160.617	JPY	22.890.000	Royal Bank of Canada	5/9/2023	3.977
USD	191.690	GBP	150.000	RBS	5/9/2023	1.542
USD	5.372.183	EUR	4.890.000	ANZ	5/9/2023	66.544
USD	15.921.387	JPY	2.271.170.000	Standard Chartered Bank	5/9/2023	379.432
USD	1.918.258	IDR	29.170.000.000	Morgan Stanley	20/9/2023	3.357
USD	916.770	IDR	13.976.165.000	Citigroup	14/9/2023	(793)
USD	3.275.369	CZK	72.640.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.378
USD	17.627	NOK	180.000	UBS	20/9/2023	715
USD	745.856	BRL	3.645.000	Goldman Sachs	14/9/2023	7.234
USD	1.069.403	PLN	4.371.000	JP Morgan	14/9/2023	8.831
USD	378.726	PLN	1.545.000	Deutsche Bank	20/9/2023	3.975
USD	1.384.196	HUF	504.270.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(49.672)
USD	1.486.936	MXN	25.386.063	Barclays	14/9/2023	(27.334)
USD	50.795	GBP	40.000	Morgan Stanley	5/9/2023	89
USD	186.690	EUR	170.000	RBS	5/9/2023	2.240
USD	285.128	JPY	41.000.000	Bank of America	20/9/2023	3.884
USD	1.367.219	CNH	9.912.000	Citigroup	14/9/2023	4.106
USD	19.673	SEK	210.000	UBS	20/9/2023	408

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	744.120	EUR	680.000	Barclays	14/9/2023	6.000
USD	744.118	CNH	5.410.000	RBS	14/9/2023	127
USD	733.734	COP	2.969.790.000	Citigroup	14/9/2023	12.913
USD	63.543	GBP	50.000	State Street	5/9/2023	160
USD	740.853	COP	3.096.026.000	BNP Paribas	17/10/2023	(3.079)
USD	14.310	NOK	150.000	Citigroup	20/9/2023	217
USD	51.039	GBP	40.000	HSBC Bank	5/9/2023	333
USD	307.853	IDR	4.720.000.000	Barclays	20/9/2023	(1.997)
USD	1.856.881	CNH	13.530.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(4.363)
USD	1.783.686	ZAR	33.895.000	Goldman Sachs	5/9/2023	(20.040)
USD	38.063	GBP	30.000	Morgan Stanley	20/9/2023	31
USD	37.490	NOK	400.000	BNP Paribas	20/9/2023	(92)
USD	1.171.783	CAD	1.590.000	Toronto-Dominion	5/9/2023	(3.525)
USD	602.141	BRL	2.947.000	Citigroup	14/9/2023	4.961
USD	1.160.733	CAD	1.570.000	Standard Chartered Bank	3/10/2023	(292)
USD	1.491.209	COP	6.115.894.026	BNY Mellon	14/9/2023	6.772
ZAR	36.300.000	USD	1.896.552	BNY Mellon	20/9/2023	32.606
ZAR	25.408.426	USD	1.367.780	Morgan Stanley	20/9/2023	(17.453)
ZAR	22.825.000	USD	1.214.570	Barclays	20/9/2023	(1.539)
ZAR	14.528.000	USD	806.502	HSBC Bank	14/9/2023	(34.005)
ZAR	26.187.000	USD	1.388.058	Citigroup	14/9/2023	4.382
ZAR	33.895.000	USD	1.781.211	Goldman Sachs	20/9/2023	20.133
Plus-value nette non réalisée						10.982.396
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	4.532.166	USD	5.189.676	BNY Mellon	15/9/2023	(52.002)
USD	93.939	CHF	82.225	BNY Mellon	15/9/2023	729
Moins-value nette non réalisée						(51.273)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	731.092	USD	101.324	BNY Mellon	15/9/2023	(778)
USD	1.776	CNY	12.909	BNY Mellon	15/9/2023	1
Moins-value nette non réalisée						(777)
Catégorie d'Actions couverte en DKK						
DKK	541	USD	79	BNY Mellon	15/9/2023	(1)
USD	2	DKK	9	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(1)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	115.219.238	USD	126.417.249	BNY Mellon	15/9/2023	(1.343.375)
USD	9.731.529	EUR	8.893.659	BNY Mellon	15/9/2023	77.212
Moins-value nette non réalisée						(1.266.163)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	229.138.253	USD	291.544.381	BNY Mellon	15/9/2023	(1.062.689)
USD	5.870.656	GBP	4.614.427	BNY Mellon	15/9/2023	20.885
Moins-value nette non réalisée						(1.041.804)
Catégorie d'Actions couverte en NOK						
NOK	603.082.129	USD	58.733.103	BNY Mellon	15/9/2023	(2.079.246)
USD	933.115	NOK	9.798.825	BNY Mellon	15/9/2023	12.615
Moins-value nette non réalisée						(2.066.631)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	9.261	USD	5.596	BNY Mellon	15/9/2023	(87)
USD	83	NZD	139	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(87)

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	193.760	USD	143.947	BNY Mellon	15/9/2023	(531)
USD	2.336	SGD	3.163	BNY Mellon	15/9/2023	(6)
Moins-value nette non réalisée						(537)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.545.406.683)						6.555.123

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(14)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	2.020.168	(10.882)
2	EUR	Euro-BTP	Septembre 2023	251.512	1.513
(4)	EUR	Euro-OAT	Septembre 2023	554.233	(2.897)
2	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	2.010.879	(9.168)
82	AUD	Australian 10 Year Bond	Septembre 2023	6.180.080	(2.701)
99	AUD	Australian 3 Year Bond	Septembre 2023	6.824.177	35.535
2	KRW	Korean 10 Year Bond	Septembre 2023	165.811	(1.679)
39	KRW	Korean 3 Year Bond	Septembre 2023	3.055.676	(5.841)
(7)	EUR	3 Month EURIBOR	Septembre 2023	1.826.315	(285)
(267)	EUR	Euro BOBL	Décembre 2023	33.999.786	(118.769)
(21)	EUR	Euro BUXL	Décembre 2023	3.039.821	(23.695)
(46)	EUR	Euro Schatz	Décembre 2023	5.261.995	(7.475)
(7)	EUR	Euro-BTP	Décembre 2023	876.799	(5.305)
59	EUR	Euro-OAT	Décembre 2023	8.146.778	50.569
18	CAD	Canadian 10 Year Bond	Décembre 2023	1.587.440	29.005
167	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	20.300.938	270.050
325	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	36.039.453	269.144
(720)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	83.508.750	(767.532)
(103)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	13.335.281	(182.929)
14	GBP	Long Gilt	Décembre 2023	1.691.831	17.747
(175)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	35.642.578	(80.520)
902	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	96.337.828	414.378
10	GBP	3 Month SONIA	Mars 2024	2.987.851	6.930
Total				365.645.980	(124.807)

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR (816.276)	Fund provides default protection on ITRAXX.XO.34.V2; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2025	(62.532)	42.901
CDS	USD 13.374.900	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.39.V1; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/12/2027	(170.518)	(443.621)
CDS	USD (7.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.BBB; and receives Fixed 3%	Goldman Sachs	17/9/2058	(724)	(1.486)
CDS	USD (9.000.000)	Fund provides default protection on Mexican; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/12/2024	(10.487)	84.996
CDS	EUR (72.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2027	1.956	8.516
CDS	USD (329.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.BBB-; and receives Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	(5.490)	(69.843)
CDS	USD (11.700.000)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	216.762	346.181
IFS	EUR 870.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,56%	Bank of America	15/6/2028	801	801

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IFS	EUR 655.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,46%	Bank of America	15/7/2028	2.801	2.801
IFS	EUR 845.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,555%	Bank of America	15/6/2033	(692)	(692)
IFS	EUR 685.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,505%	Bank of America	15/7/2033	(2.902)	(2.902)
IFS	EUR 222.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,5737%	Bank of America	15/5/2038	(1.087)	(1.087)
IFS	EUR 410.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,60125%	Bank of America	15/5/2043	(4.692)	(4.403)
IFS	EUR 405.000	Fund receives default protection CPTFEMU + 0bps; and pays Fixed 2,435%	BNP Paribas	15/5/2033	4.299	4.431
IRS	BRL 12.412.000	Fund receives Fixed 9,98%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2026	(6.245)	(6.245)
IRS	BRL 36.993.198	Fund receives Fixed 10,66%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2025	(825)	(825)
IRS	BRL 1.629.938	Fund receives Fixed 11,5625%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	8.707	8.707
IRS	BRL 2.480.230	Fund receives Fixed 11,82%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Barclays	2/1/2026	16.521	16.521
IRS	BRL 200.000	Fund receives Fixed 9,94%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	BNP Paribas	4/1/2027	(424)	(424)
IRS	EUR 81.800.000	Fund receives Fixed 1,75%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	4/5/2024	(1.285.991)	(1.285.991)
IRS	EUR 40.900.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 1%	Bank of America	4/5/2024	860.933	860.933
IRS	KRW 4.277.040.000	Fund receives Fixed 3,865%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	3/7/2024	1.554	1.554
IRS	USD 24.330.000	Fund receives Fixed 5,3998%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	12/7/2024	(12.913)	(12.913)
IRS	GBP 31.230.000	Fund receives Fixed 4,255%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	6/9/2024	(562.486)	(561.737)
IRS	NZD 5.165.000	Fund receives Fixed 4,697%; and pays Floating NZD BBR 3 Month	Bank of America	20/12/2024	(25.642)	(25.642)
IRS	AUD 4.475.000	Fund receives Floating AUD BBSW 3 Month; and pays Fixed 4,0425%	Bank of America	20/12/2024	5.318	5.318
IRS	JPY 120.620.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,23%	Bank of America	11/1/2025	(1.978)	(1.978)
IRS	JPY 741.200.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,235%	Bank of America	19/1/2025	(12.544)	(12.544)
IRS	MXN 102.845.265	Fund receives Fixed 9,92%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	5/2/2025	(51.236)	(51.236)
IRS	MXN 61.620.000	Fund receives Fixed 9,95%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	7/2/2025	(29.028)	(29.028)
IRS	AUD 4.180.000	Fund receives Floating AUD BBSW 3 Month; and pays Fixed 3,8025%	Bank of America	9/2/2025	15.212	15.212
IRS	NZD 4.650.000	Fund receives Fixed 4,94%; and pays Floating NZD BBR 3 Month	Bank of America	10/2/2025	(23.539)	(23.539)
IRS	USD 28.412.000	Fund receives Fixed 2,601%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	17/2/2025	(1.003.104)	(1.003.104)
IRS	USD 28.410.000	Fund receives Fixed 2,701%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	17/2/2025	(963.467)	(963.467)
IRS	USD 26.994.000	Fund receives Fixed 4,104%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	11/8/2025	(363.436)	(363.436)
IRS	GBP 1.280.000	Fund receives Fixed 5,795%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/8/2025	8.164	8.164
IRS	JPY 567.000.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,1045%	Bank of America	20/9/2025	3.215	3.215
IRS	GBP 1.240.000	Fund receives Fixed 3,6%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/3/2026	(16.372)	(16.436)
IRS	GBP 360.000	Fund receives Fixed 3,75343%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	17/3/2026	(5.013)	(4.158)
IRS	GBP 630.000	Fund receives Fixed 3,7%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	31/3/2026	(7.521)	(7.521)
IRS	JPY 752.070.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,266%	Bank of America	7/7/2026	8.744	8.744

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	JPY 169.670.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,2925%	Bank of America	7/7/2026	1.667	1.667
IRS	JPY 169.650.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,3205%	Bank of America	7/7/2026	1.344	1.344
IRS	JPY 169.680.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,324%	Bank of America	7/7/2026	1.304	1.304
IRS	JPY 508.930.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,33%	Bank of America	7/7/2026	3.703	3.703
IRS	JPY 259.590.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,331%	Bank of America	7/7/2026	1.871	1.871
IRS	JPY 249.410.000	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,364%	Bank of America	7/7/2026	1.238	1.238
IRS	KRW 2.566.795.000	Fund receives Fixed 3,376%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(15.038)	(15.038)
IRS	KRW 2.566.795.000	Fund receives Fixed 3,384%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(14.599)	(14.599)
IRS	KRW 2.566.410.000	Fund receives Fixed 3,389%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(14.323)	(14.322)
IRS	BRL 390.000	Fund receives Fixed 10,11%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(460)	(460)
IRS	JPY 4.104.070.542	Fund receives Fixed 0,035%; and pays Floating JPY TONAR 1 Day	Bank of America	18/1/2027	(143.607)	(230.218)
IRS	GBP 2.650.000	Fund receives Fixed 3,44723%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	16/3/2027	(30.278)	(26.531)
IRS	GBP 2.740.000	Fund receives Fixed 3,175%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/1/2028	(26.447)	(26.376)
IRS	GBP 43.020.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 3,46255%	Bank of America	1/3/2028	284.224	276.032
IRS	GBP 280.000	Fund receives Fixed 4,86823%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	4/8/2028	662	925
IRS	GBP 280.000	Fund receives Fixed 4,8733%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	4/8/2028	1.002	1.002
IRS	GBP 260.000	Fund receives Fixed 4,77918%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	11/8/2028	927	(346)
IRS	GBP 280.000	Fund receives Fixed 4,9008%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	11/8/2028	1.475	1.475
IRS	USD 6.760.000	Fund receives Fixed 3,04%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/10/2032	(414.084)	(414.084)
IRS	AUD 970.000	Fund receives Fixed 4,15%; and pays Floating AUD BBSW 6 Month	Bank of America	9/2/2033	(10.880)	(10.880)
IRS	NZD 1.080.000	Fund receives Floating NZD BBR 3 Month; and pays Fixed 4,2525%	Bank of America	10/2/2033	22.299	22.299
IRS	MXN 64.820.000	Fund receives Fixed 8,66%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	9/3/2033	(27.759)	(27.759)
IRS	EUR 1.140.000	Fund receives Fixed 2,962%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	31/3/2033	(9.038)	(8.888)
IRS	CHF 660.000	Fund receives Floating CHF SARON 1 Day; and pays Fixed 1,912%	Bank of America	31/3/2033	(13.306)	(12.650)
IRS	GBP 200.000	Fund receives Fixed 3,4329%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/6/2033	(2.969)	(2.969)
IRS	GBP 270.000	Fund receives Fixed 3,6589%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	26/6/2033	(1.237)	(1.237)
IRS	USD 7.230.000	Fund receives Fixed 3,7565%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	9/8/2033	(43.102)	(43.102)
IRS	USD 3.537.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,23%	Bank of America	9/8/2033	173.117	173.117
IRS	EUR 530.000	Fund receives Fixed 2,85708%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	28/8/2033	1.475	1.358
IRS	EUR 80.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,668%	Bank of America	4/2/2048	2.796	2.796
IRS	EUR 500.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,8133%	Bank of America	15/8/2048	2.555	2.555
IRS	GBP 5.410.000	Fund receives Fixed 0,701161%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	13/9/2051	(3.091.803)	(3.721.519)
IRS	EUR 30.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,761%	Bank of America	4/10/2052	(131)	(131)

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	EUR 130.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,2705%	Bank of America	4/3/2053	12.845	12.845
IRS	CHF 270.000	Fund receives Fixed 1,8565%; and pays Floating CHF SARON 1 Day	Bank of America	31/3/2053	10.222	9.512
IRS	EUR 300.000	Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month; and pays Fixed 2,508%	Bank of America	31/3/2053	14.162	14.060
IRS	GBP 100.000	Fund receives Fixed 5,628%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	19/8/2025	392	410
IRS	GBP 2.650.000	Fund receives Fixed 5,65%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	22/8/2025	11.686	11.686
IRS	GBP 3.930.000	Fund receives Fixed 5,4%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	BNP Paribas	23/8/2025	6.451	6.295
IRS	GBP 4.170.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 4,75%	Bank of America	26/8/2026	(7.271)	(6.785)
IRS	ZAR 45.606.288	Fund receives Floating ZAR JIBAR 3 Month; and pays Fixed 8,22%	Goldman Sachs	20/9/2026	(20.430)	(20.430)
IRS	EUR 900.000	Fund receives Fixed 2,78%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	1/8/2033	(863)	(442)
IRS	EUR 450.000	Fund receives Fixed 3%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	BNP Paribas	17/8/2033	4.346	4.041
IRS	EUR 2.140.000	Fund receives Fixed 3,0313%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	23/8/2033	21.995	21.995
IRS	USD 2.500.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,8642%	Bank of America	23/8/2033	(28.709)	(28.709)
IRS	EUR 1.420.000	Fund receives Fixed 2,87515%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	25/8/2033	4.986	4.823
IRS	USD 1.670.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,71334%	Bank of America	25/8/2033	(11.012)	(9.732)
IRS	USD 610.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,828%	Bank of America	26/8/2035	(12.180)	(12.068)
IRS	BRL 56.012.728	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(1.905)	(1.905)
IRS	BRL 1.609.720	Fund receives Fixed 11,76%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	10.202	10.202
IRS	COP 4.973.573.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 10,2%	Goldman Sachs	28/2/2025	438	438
IRS	BRL 13.335.000	Fund receives Fixed 10,1075%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	2/1/2026	106	106
IRS	BRL 11.269.546	Fund receives Fixed 10,005%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(23.271)	(23.271)
IRS	BRL 1.680.657	Fund receives Fixed 11,775%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	2/1/2026	10.787	10.787
IRS	BRL 390.000	Fund receives Fixed 10,425%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	JP Morgan	4/1/2027	2	2
IRS	BRL 85.653.168	Fund receives Fixed 10,6525%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2025	(3.603)	(3.603)
IRS	BRL 2.955.570	Fund receives Fixed 11,83%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Morgan Stanley	2/1/2026	19.847	19.847
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 561.120.886)					(6.814.080)	(7.533.582)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
70.000	Put	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1,018	12/9/2023	(2.951)	-
630.000	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 150	1/5/2024	1.157	4.823
730.000	Call	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,125	20/12/2023	(3.868)	3.322
5.890.000	Call	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7,82	10/11/2023	1.567	8.488
1.080.000	Call	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,133	12/10/2023	(7.717)	384
980.000	Put	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6,9	18/10/2023	(4.552)	45

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
880.000	Put	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1,06	20/10/2023	141.789	298.773
72.501.000	Put	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,07	27/9/2023	(101.232)	269
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 8.968.403)						24.193	316.104

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
(5.890.000)	Call	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7,85	10/11/2023	504	(968)
(980.000)	Put	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6,775	18/10/2023	1.816	(2)
(730.000)	Call	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1,125	20/12/2023	8.796	(3.322)
(72.501.000)	Call	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,57	27/9/2023	27.750	-
(72.501.000)	Call	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0,68	27/9/2023	61.798	(17.953)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 271.572)						100.664	(22.245)

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD 50.000.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,8% Fixed semi-annually from 13/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 13/9/2024	Morgan Stanley	11/9/2023	(343.501)	25.999
USD 3.982.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,6% Fixed semi-annually from 15/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/9/2024	Citibank	13/9/2023	(29.734)	433
USD 4.353.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,81% Fixed semi-annually from 25/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 25/9/2024	Morgan Stanley	21/9/2023	(91.459)	5
USD 2.631.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/11/2024; and pays 3,65% Fixed semi-annually from 3/5/2024	Citibank	1/11/2023	18.087	48.808
USD 2.740.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 9/11/2024; and pays 2,82% Fixed semi-annually from 9/5/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(32.293)	1.013
USD 2.740.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 9/11/2024; and pays 4,82% Fixed semi-annually from 9/5/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	(42.522)	2.050
USD 2.068.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2,85% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 9/11/2024	Citibank	14/11/2023	(87.320)	3.614
JPY 168.680.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	8.019	17.616
JPY 104.581.600	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	5.010	10.922
JPY 64.098.400	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024; and pays 0,8% Fixed annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	3.076	6.694
USD 104.590.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,45% Fixed semi-annually from 14/8/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/2/2025	Citibank	12/2/2024	(102.959)	160.607
EUR 15.180.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/10/2024; and pays 3,37% Fixed annually from 29/7/2025	Citibank	25/7/2024	(7.379)	63.802
EUR 13.420.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 9/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024	JP Morgan	7/8/2024	(3.678)	40.575
EUR 13.480.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 29/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024	JP Morgan	27/8/2024	(3.967)	44.107
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 64.866.386)				(710.620)	426.245

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (50.000.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 13/9/2024; and pays 3,5% Fixed semi-annually from 13/3/2024	Morgan Stanley	11/9/2023	174.106	(894)
USD (3.982.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 15/9/2024; and pays 3,1% Fixed semi-annually from 15/3/2024	Citibank	13/9/2023	7.416	(1)
USD (3.982.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,3% Fixed semi-annually from 15/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 15/9/2024	Citibank	13/9/2023	4.000	(3.022)
USD (7.230.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,93% Fixed semi-annually from 4/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 4/10/2024	Goldman Sachs	2/10/2023	2.052	(49.948)
USD (43.987.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,25% Fixed semi-annually from 17/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 17/10/2024	Citibank	13/10/2023	(321.439)	(409.413)
USD (10.151.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,5% Fixed semi-annually from 17/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 17/10/2024	Goldman Sachs	13/10/2023	(195.301)	(297.301)
USD (20.463.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,05% Fixed semi-annually from 18/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 18/10/2024	Goldman Sachs	16/10/2023	(195.909)	(259.345)
USD (13.382.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,4% Fixed semi-annually from 30/4/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 30/10/2024	Goldman Sachs	27/10/2023	25.634	(33.247)
USD (26.312.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 5% Fixed semi-annually from 3/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 3/11/2024	Citibank	1/11/2023	16.393	(33.328)
USD (10.970.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 9/11/2024; and pays 3,26% Fixed semi-annually from 9/5/2024	Goldman Sachs	7/11/2023	42.607	(1.470)
USD (84.000.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,8% Fixed semi-annually from 10/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 10/11/2024	Goldman Sachs	8/11/2023	(40.736)	(219.656)
USD (39.500.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,85% Fixed semi-annually from 14/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 14/11/2024	JP Morgan	10/11/2023	(33.364)	(87.874)
USD (20.680.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 16/11/2024; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 16/5/2024	Citibank	14/11/2023	67.254	(1.190)
USD (20.680.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,75% Fixed semi-annually from 16/5/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 16/11/2024	Citibank	14/11/2023	3.044	(63.445)
USD (13.670.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,9% Fixed semi-annually from 5/6/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 5/12/2024	Citibank	1/12/2023	(103.504)	(189.625)
JPY (168.680.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 24/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 24/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(2.842)	(8.174)
JPY (104.581.600)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 22/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(1.784)	(5.068)
JPY (64.098.400)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed annually from 22/12/2024; and pays Floating JPY TONAR annually from 22/12/2024	Morgan Stanley	20/12/2023	(1.096)	(3.106)
USD (13.670.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 19/1/2025; and pays 2,75% Fixed semi-annually from 19/7/2024	Citibank	17/1/2024	71.638	(6.281)
USD (104.590.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 14/2/2025; and pays 3,75% Fixed semi-annually from 14/8/2024	Citibank	12/2/2024	42.731	(61.859)
USD (24.750.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,79% Fixed semi-annually from 1/10/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 1/4/2025	JP Morgan	27/3/2024	(162.349)	(417.522)
USD (17.180.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,495% Fixed semi-annually from 29/1/2025; and pays Floating USD SOFR annually from 29/7/2025	JP Morgan	25/7/2024	584	(70.455)
EUR (13.420.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 9/8/2024	JP Morgan	7/8/2024	1.675	(13.224)

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾ suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
EUR (13.480.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 29/8/2025	JP Morgan	27/8/2024	(1.495)	(14.897)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 172.192.279)				(600.685)	(2.250.345)

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 2.080.000	Fannie Mae or Freddie Mac 1,5% TBA	1.775.501	0,19
USD 2.560.000	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	2.245.633	0,24
USD 1.394.000	Fannie Mae or Freddie Mac 2,5% TBA	1.254.690	0,14
USD 839.000	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	774.878	0,08
USD 3.879.537	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	3.343.378	0,36
USD 210.000	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	197.909	0,02
USD 20.075.025	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	17.935.151	1,94
USD 3.261.000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	3.009.942	0,32
USD 2.652.700	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	2.515.721	0,27
USD 2.071.000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	2.008.584	0,22
USD 3.510.700	Ginnie Mae 2% TBA	2.904.556	0,31
USD 4.044.400	Ginnie Mae 2,5% TBA	3.448.278	0,37
USD 2.484.600	Ginnie Mae 3% TBA	2.186.257	0,24
USD 1.400.000	Ginnie Mae 4% TBA	1.303.373	0,14

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
USD 1.024.000	Ginnie Mae 4,5% TBA	975.923	0,11
USD 1.108.000	Ginnie Mae 5% TBA	1.079.238	0,12
USD 7.378.008	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	5.882.808	0,64
USD 6.589.900	Fannie Mae or Freddie Mac 2,5% TBA	5.466.194	0,59
USD 1.422.500	Fannie Mae or Freddie Mac 1,5% TBA	1.074.876	0,12
USD 2.147.000	Ginnie Mae 3,5% TBA	1.950.348	0,21
USD 160.000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	153.503	0,02
USD 191.000	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	185.903	0,02
USD 1.754.000	Fannie Mae or Freddie Mac 5,5% TBA	1.732.772	0,19
USD 23.196.000	Fannie Mae or Freddie Mac 6% TBA	23.250.665	2,51
USD 500.000	Fannie Mae or Freddie Mac 6,5% TBA	507.741	0,05
USD 876.000	Ginnie Mae 5,5% TBA	867.588	0,09
USD 470.000	Ginnie Mae 6% TBA	471.402	0,05
USD 223.000	Ginnie Mae 6,5% TBA	226.034	0,03
Total TBA (USD Exposition sous-jacente - USD 88.728.846)		88.728.846	9,59

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund⁽⁵⁾ suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	42,72
Valeurs industrielles	33,11
Finance	11,08
Biens de consommation cyclique	3,62
Technologie	3,34
Communications	2,93
Services aux collectivités	1,93
Fonds d'investissement	1,37
Autres éléments du passif net	(0,10)
	100,00

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic China A-Share Opportunities Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
1.021	USD	SGX FTSE China A50 Index	Septembre 2023	12.916.671	180.575
Total				12.916.671	180.575

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	22,17
Biens de consommation cyclique	21,89
Finance	16,76
Valeurs industrielles	12,11
Matériaux de base	6,88
Technologie	6,20
Énergie	5,77
Communications	5,03
Services aux collectivités	0,68
Autres éléments de l'actif net	2,51
	100,00

Systematic China Environmental Tech Fund⁽²⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				48.800	Focused Photonics Hangzhou	105.108	0,65
ACTIONS ORDINAIRES				185.960	Goldwind Science & Technology	97.687	0,61
Bermudes				415.900	Goldwind Science & Technology	543.073	3,37
4.200	China Resources Gas	11.808	0,07	25.647	Gongniu	373.670	2,32
Îles Caïmans				224.800	Guangzhou Automobile	118.376	0,73
176.150	AAC Technologies	341.386	2,12	61.900	Henan Pinggao Electric	89.676	0,56
189.200	China High Speed Transmission Equipment	61.515	0,38	39.400	Hengdian DMEGC Magnetics	88.869	0,55
244.800	China Yongda Automobiles Services	108.620	0,67	103.000	JA Solar Technology	394.000	2,45
119.700	CIMC Enric	113.855	0,71	11.000	Jiangsu Linyang Energy	11.234	0,07
334.250	Geely Automobile	415.097	2,58	185.200	LONGi Green Energy Technology	675.852	4,20
60.025	Kingboard	136.229	0,85	1.000	NAURA Technology	37.285	0,23
3.051	Kingsoft Cloud	17.330	0,11	510.700	Offshore Oil Engineering	408.540	2,54
87.665	Li Auto	1.806.287	11,22	145.100	Risen Energy	400.477	2,49
355.600	Nexteer Automotive	228.967	1,42	321.600	Shanghai Electric	197.592	1,23
93.227	NIO	990.537	6,15	207.800	Shanghai Electric	46.631	0,29
110.200	Tianneng Power International	117.465	0,73	152.400	Shanghai Tunnel Engineering	122.543	0,76
54.900	Xinyi Solar	45.850	0,28	19.400	Shenzhen New Energy Technology	236.202	1,47
90.520	XPeng	848.880	5,27	25.100	Shenzhen Sinexcel Electric	110.469	0,69
136.500	Yadea	262.454	1,63	70.300	Shenzhen Sunway Communication	167.263	1,04
		5.494.472	34,12	26.900	Sungrow Power Supply	368.817	2,29
Chine				45.800	Tongwei	201.951	1,25
98.000	Angang Steel	25.115	0,16	245.100	Weichai Power	397.531	2,47
8.900	Anhui Heli	24.368	0,15	232.000	Yutong Bus	397.650	2,47
363.850	BAIC Motor	100.670	0,63	142.435	Zhejiang Qianjiang Motorcycle	284.073	1,76
207.600	Beijing Jingneng Clean Energy	44.204	0,27	57.060	ZTE	183.701	1,14
291.700	Beijing-Shanghai High Speed Railway	204.481	1,27			10.130.702	62,91
3.500	BYD	109.690	0,68	Hong Kong			
12.000	BYD	411.362	2,55	47.150	BYD Electronic International	218.527	1,36
271.870	China Railway Signal & Communication	209.638	1,30	8.000	Hua Hong Semiconductor	20.910	0,13
527.600	China State Construction Engineering	408.281	2,53			239.437	1,49
236.900	China Three Gorges Renewables	160.205	1,00	Total des actions ordinaires			
44.800	Contemporary Amperex Technology	1.456.622	9,05			15.876.419	98,59
194.000	CRRC	95.479	0,59	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
427.100	CRRC	348.708	2,16			15.876.419	98,59
625.100	Dongfeng Motor	229.541	1,43	Total du portefeuille			
101.700	ENN Natural Gas	244.068	1,51			15.876.419	98,59
				Autres éléments de l'actif net			
						226.829	1,41
				Total de l'actif net (USD)			
						16.103.248	100,00

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic China Environmental Tech Fund⁽²⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	5.293	USD	5.805	BNY Mellon	15/9/2023	(59)
USD	872	EUR	798	BNY Mellon	15/9/2023	5
Moins-value nette non réalisée						(54)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 6.608)						(54)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-value non réalisée USD
15	USD	SGX FTSE China A50 Index	Septembre 2023	189.765	2.515
Total				189.765	2.515

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation cyclique	51,44
Valeurs industrielles	22,61
Énergie	18,03
Communications	2,18
Services aux collectivités	1,58
Biens de consommation non cyclique	1,27
Matériaux de base	1,01
Technologie	0,47
Autres éléments de l'actif net	1,41
	100,00

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Global Equity High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
30.200	Hong Kong Exchanges & Clearing	1.170.576	0,02	151.700	Tokio Marine	3.349.430	0,07
7.172.000	Lenovo	8.111.160	0,16	271.800	Tokyo Electron*	40.122.378	0,80
2.315.500	Power Assets	11.410.728	0,23	217.300	Toyota Motor*	3.739.247	0,07
820.000	Sino Land	939.924	0,02	18.400	Trend Micro*	779.156	0,02
288.000	Swire Pacific*	2.375.832	0,05	19.600	Yamaha Motor	506.780	0,01
		62.585.723	1,26	189.100	ZOZO*	3.764.405	0,08
						571.246.054	11,40
	Inde				Jersey		
122.322	Asian Paints	4.811.096	0,10	68.511	Experian	2.416.979	0,05
11.371	Eicher Motors	458.295	0,01	146.431	WPP	1.417.790	0,03
531.142	ICICI Bank	6.151.170	0,12			3.834.769	0,08
50.971	Kotak Mahindra Bank	1.082.852	0,02		Luxembourg		
25.200	Maruti Suzuki India	3.045.140	0,06	177.267	ArcelorMittal	4.740.811	0,09
87.294	Reliance Industries	2.538.062	0,05		Malaisie		
41.717	Tata Consultancy Services	1.691.532	0,03	2.102.000	CIMB	2.550.486	0,05
21.070	Titan	790.116	0,02	347.000	IOI	301.381	0,00
87.132	UPL	622.182	0,01	12.109.000	Malayan Banking	23.774.335	0,48
		21.190.445	0,42	100.400	Nestle Malaysia	2.823.748	0,06
	Indonésie			196.300	Petronas Gas	724.279	0,01
7.694.400	Bank Mandiri Persero	3.043.911	0,06	98.200	PPB	332.695	0,01
	Irlande			2.425.500	Public Bank	2.211.176	0,04
12.161	Kingspan	1.026.494	0,02	3.615.800	RHB Bank	4.371.686	0,09
13.969	Linde	5.431.287	0,11	705.300	Sime Darby	349.610	0,01
23.489	Trane Technologies	4.841.553	0,10	1.225.000	Tenaga Nasional	2.597.843	0,05
		11.299.334	0,23			40.037.239	0,80
	Israël				Mexique		
321.873	Israel Discount Bank	1.616.657	0,03	7.298.951	America Movil	7.117.739	0,14
	Italie			894.832	Coca-Cola Femsa	7.936.420	0,16
367.108	Mediobanca Banca di Credito Finanziario	4.835.266	0,10	421.450	Wal-Mart de Mexico	1.720.755	0,03
						16.774.914	0,33
	Japon				Pays-Bas		
137.100	Asahi Kasei*	883.451	0,02	65.312	ABN AMRO Bank	973.970	0,02
1.227.600	Astellas Pharma	18.600.258	0,37	195.918	ING Groep	2.813.023	0,05
142.100	Brother Industries	2.400.013	0,05	120.899	Koninklijke Ahold Delhaize	3.979.006	0,08
439.200	Canon	10.782.046	0,21	75.127	NN*	2.913.935	0,06
39.400	Daito Trust Construction*	4.330.753	0,08			10.679.934	0,21
29.100	Fast Retailing*	6.665.993	0,13		Nouvelle-Zélande		
152.600	FUJIFILM	8.993.853	0,18	253.590	Fisher & Paykel Healthcare	3.425.182	0,07
3.900	Fujitsu*	485.782	0,01		Singapour		
4.916.200	Japan Post*	37.572.416	0,75	121.400	DBS	2.990.736	0,06
1.929.100	Japan Tobacco	42.118.021	0,84	97.300	Oversea-Chinese Banking	903.383	0,02
1.629.000	KDDI*	48.205.168	0,96	6.301.400	Singapore Telecommunications	11.095.050	0,22
1.092.200	Kirin	15.289.533	0,30			14.989.169	0,30
37.100	Komatsu	1.053.437	0,02		Afrique du Sud		
620.200	Mitsubishi*	30.535.802	0,61	58.371	African Rainbow Minerals*	557.211	0,01
59.200	Mitsubishi UFJ Financial	471.275	0,01		Suède		
32.000	Mitsui	1.189.313	0,02	299.417	Epiroc	5.780.165	0,12
742.200	MS&AD Insurance*	26.609.618	0,53	311.221	Tele2	2.212.077	0,04
39.700	NGK Insulators*	525.331	0,01			7.992.242	0,16
287.100	Nintendo*	12.310.602	0,25		Suisse		
15.400	NIPPON EXPRESS	797.527	0,02	10.539	Chubb	2.132.040	0,04
505.500	Nippon Steel*	11.921.993	0,24	657.931	Garmin	70.128.865	1,40
53.259.300	Nippon Telegraph & Telephone	61.329.013	1,22	147.980	Logitech International*	10.260.645	0,21
81.100	Nippon Yusen	2.156.304	0,04	863.758	Novartis*	87.626.722	1,75
9.300	Nissin Foods*	809.387	0,02			170.148.272	3,40
316.200	Ono Pharmaceutical	5.974.387	0,12		Taïwan		
25.600	Otsuka	971.418	0,02	39.920	Advantech	431.208	0,01
222.300	Seiko Epson*	3.471.656	0,07	738.000	Asia Cement	924.628	0,02
614.100	Sekisui House	12.481.163	0,25	784.000	Asustek Computer	9.908.773	0,20
898.500	Shionogi	39.449.048	0,79	214.000	Catcher Technology	1.212.911	0,02
5.262.000	SoftBank	60.124.811	1,20				
230.200	Subaru	4.425.076	0,09				
8.014.500	Sumitomo Chemical*	22.120.693	0,44				
288.500	Suzuki Motor*	11.320.501	0,23				
408.800	Takeda Pharmaceutical*	12.609.016	0,25				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Global Equity High Income Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
437.020	VeriSign	91.905.306	1,84	Autres titres négociables			
1.155.463	Verizon Communications	40.279.440	0,81	ACTIONS ORDINAIRES			
434.644	Visa*	107.344.029	2,14	Mexique			
5.059	Vulcan Materials	1.102.862	0,02	1	Sitios Latinoamerica	-	0,00
699.099	Walmart	113.191.119	2,26	Total des actions ordinaires			
22.509	WW Grainger	16.386.552	0,33	Total des autres valeurs mobilières			
		2.881.506.494	57,53	Total du portefeuille			
Total des actions ordinaires et privilégiées		4.742.939.485	94,69	Autres éléments de l'actif net			
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		4.742.939.485	94,69	Total de l'actif net (USD)			
				5.008.709.927 100,00			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	369.520.897	USD	240.589.482	BNY Mellon	15/9/2023	(1.134.335)
USD	9.516.068	AUD	14.797.666	BNY Mellon	15/9/2023	(72.998)
Moins-value nette non réalisée						(1.207.333)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	74.963.366	USD	55.702.816	BNY Mellon	15/9/2023	(282.255)
USD	1.916.637	CAD	2.594.970	BNY Mellon	15/9/2023	(1.829)
Moins-value nette non réalisée						(284.084)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	93.294.461	USD	106.802.406	BNY Mellon	15/9/2023	(1.043.616)
USD	4.997.751	CHF	4.386.903	BNY Mellon	15/9/2023	24.780
Moins-value nette non réalisée						(1.018.836)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	4.239.098.170	USD	587.098.899	BNY Mellon	15/9/2023	(4.099.217)
USD	25.046.066	CNY	182.140.159	BNY Mellon	15/9/2023	(3.419)
Moins-value nette non réalisée						(4.102.636)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	72.412.718	USD	79.433.289	BNY Mellon	15/9/2023	(827.163)
USD	3.241.760	EUR	2.974.912	BNY Mellon	15/9/2023	12.417
Moins-value nette non réalisée						(814.746)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	82.537.508	USD	105.007.701	BNY Mellon	15/9/2023	(373.773)
USD	6.174.250	GBP	4.862.393	BNY Mellon	15/9/2023	10.127
Moins-value nette non réalisée						(363.646)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	4.825.699.701	USD	618.210.278	BNY Mellon	15/9/2023	(2.589.320)
USD	22.527.787	HKD	176.314.011	BNY Mellon	15/9/2023	35.205
Moins-value nette non réalisée						(2.554.115)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	42.056.069	USD	25.393.927	BNY Mellon	15/9/2023	(380.435)
USD	1.264.766	NZD	2.122.579	BNY Mellon	15/9/2023	2.330
Moins-value nette non réalisée						(378.105)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Global Equity High Income Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	247.449	SGD	335.000	BNY Mellon	5/9/2023	(395)
SGD	22.455.731	USD	16.675.229	BNY Mellon	15/9/2023	(54.121)
USD	688.802	SGD	932.396	BNY Mellon	15/9/2023	(1.330)
Moins-value nette non réalisée						(55.846)
Catégorie d'Actions couverte en ZAR						
USD	301.025	ZAR	5.696.191	BNY Mellon	15/9/2023	(1.833)
ZAR	127.203.295	USD	6.745.449	BNY Mellon	15/9/2023	17.744
Plus-value nette non réalisée						15.911
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.904.578.602)						(10.763.436)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
1.611	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	75.804.114	(368.489)
365	GBP	FTSE 100 Index	Septembre 2023	34.692.665	(122.159)
3.229	USD	S&P 500 E-Mini Index	Septembre 2023	732.296.838	4.141.707
827	JPY	Nikkei 225 (Yen)	Septembre 2023	92.401.304	536.072
Total				935.194.921	4.187.131

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(850)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.590	1/9/2023	3.210.251	(89.250)
(598)	Call	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 33.000	8/9/2023	1.228.198	(470.528)
(616)	Call	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 32.625	8/9/2023	46.747	(1.095.823)
(797)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.530	8/9/2023	592.960	(2.371.075)
(772)	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4.350	15/9/2023	(61.371)	(340.057)
(742)	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4.275	15/9/2023	(311.523)	(705.206)
(294)	Call	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 7.475	15/9/2023	(170.136)	(290.697)
(300)	Call	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 7.350	15/9/2023	(412.332)	(639.846)
(756)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.435	15/9/2023	(5.546.951)	(8.493.660)
(689)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.430	22/9/2023	(6.017.663)	(8.919.105)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 807.660.454)						(7.441.820)	(23.415.247)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Global Equity High Income Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	23,95
Communications	17,33
Technologie	15,34
Biens de consommation cyclique	10,52
Finance	10,45
Valeurs industrielles	9,03
Énergie	3,97
Services aux collectivités	2,08
Matériaux de base	1,83
Diversifiés	0,19
Autres éléments de l'actif net	5,31
	100,00

Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund⁽²⁾

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
COMPARTIMENTS							
Irlande							
34.600	BlackRock Global Corporate Sustainable Credit Screened Fund ⁻	3.600.855	16,37	21.000	China Construction Bank	11.246	0,05
34.550	BlackRock ICAV I - BlackRock Global High Yield Sustainable Credit Screened Fund ⁻	3.599.848	16,37	3.500	China Merchants Bank	13.834	0,06
Total des Compartiments				4.500	COSCO SHIPPING	4.619	0,02
				12.000	Dongfeng Motor	4.406	0,02
				35.000	Industrial & Commercial Bank of China	16.065	0,08
				3.000	Ping An Insurance of China	17.959	0,08
				900	WuXi AppTec	9.857	0,05
				77.986 0,36			
				Colombie			
				249	Bancolombia	1.759	0,01
				746	Bancolombia	5.083	0,03
				6.842 0,04			
				République tchèque			
				33	Komerční Banka	1.049	0,00
				Danemark			
				1.087	Novo Nordisk	202.225	0,92
				30	Pandora	3.110	0,01
				205.335 0,93			
				Finlande			
				2.476	Kesko	48.542	0,22
				312	Neste	11.434	0,05
				3.335	Nokia	13.388	0,06
				77	UPM-Kymmene	2.655	0,02
				76.019 0,35			
				France			
				1.254	Engie	20.351	0,09
				327	Gecina	34.999	0,16
				61	Kering	32.988	0,15
				486	Klepierre	12.987	0,06
				3.406	Orange	38.490	0,17
				504	Schneider Electric	87.205	0,40
				205	Valeo	4.036	0,02
				231.056 1,05			
				Allemagne			
				52	Bayerische Motoren Werke	5.075	0,02
				214	Infineon Technologies	7.699	0,04
				12	Merck	2.173	0,01
				153	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft in Muenchen	59.709	0,27
				1.293	SAP	182.340	0,83
				18	Siemens	2.721	0,01
				259.717 1,18			
				Hong Kong			
				3.800	AIA	34.497	0,16
				29.500	BOC Hong Kong	81.997	0,37
				18.000	Fosun International	11.269	0,05
				8.000	MTR	33.406	0,15
				5.000	New World Development	10.621	0,05
				4.000	Sino Land	4.585	0,02
				7.500	Swire Pacific	61.871	0,28
				13.800	Swire Properties	28.856	0,13
				267.102 1,21			
				Hongrie			
				2.375	MOL Hungarian Oil & Gas	18.145	0,08
				Indonésie			
				13.400	Bank Central Asia	8.073	0,03
				16.600	Unilever Indonesia	4.000	0,02
				12.073 0,05			
				Australie			
1.446	Aristocrat Leisure	38.309	0,17				
13.217	Brambles	128.163	0,58				
412	Commonwealth Bank of Australia	27.269	0,12				
1.786	Fortescue Metals	24.792	0,11				
1.277	QBE Insurance	12.391	0,06				
5.810	Transurban	49.903	0,23				
3.754	Vicinity	4.548	0,02				
				285.375 1,29			
				Belgique			
268	KBC	17.661	0,08				
				Bermudes			
1.119	Bunge	128.338	0,58				
500	Orient Overseas International	6.706	0,03				
				135.044 0,61			
				Brésil			
5.007	Ambev	14.289	0,07				
2.518	Petroleo Brasileiro	17.974	0,08				
5.020	Petroleo Brasileiro	32.962	0,15				
				65.225 0,30			
				Canada			
2.197	ARC Resources	33.243	0,15				
2.252	Bank of Nova Scotia/The Canadian Imperial Bank of Commerce	107.435	0,49				
2.222	Enbridge	78.640	0,36				
383	Franco-Nevada	55.338	0,25				
205	George Weston	22.915	0,10				
354	Gibson Energy	5.286	0,02				
329	Gildan Activewear	9.917	0,05				
2.538	Hydro One	68.194	0,31				
16	Kinaxis	1.950	0,01				
13	National Bank of Canada	921	0,00				
134	Royal Bank of Canada	12.208	0,06				
354	Shopify	22.959	0,11				
532	Wheaton Precious Metals	23.276	0,11				
				447.104 2,04			
				Îles Caïmans			
400	Alibaba	4.600	0,02				
350	Baidu	6.221	0,03				
26.000	HKT Trust & HKT	27.714	0,13				
600	Li Auto	12.362	0,06				
70	Meituan	1.147	0,00				
700	Tencent	29.007	0,13				
94	Vipshop	1.491	0,01				
8.000	Yadea	15.382	0,07				
				97.924 0,45			

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund⁽²⁾

suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Irlande				Portugal			
1.133	Johnson Controls International	67.187	0,31	1.709	Galp Energia SGPS	23.548	0,11
913	Trane Technologies	188.188	0,86	Singapour			
		255.375	1,17	600	DBS	14.781	0,07
Israël				1.500	Oversea-Chinese Banking	13.927	0,06
126	Bank Hapoalim	1.050	0,01	2.200	Singapore Airlines	11.181	0,05
122	Wix.com	11.937	0,05	19.100	Singapore Telecommunications	33.630	0,15
		12.987	0,06	200	United Overseas Bank	4.208	0,02
Italie						77.727	0,35
2.975	Enel	20.128	0,09	Afrique du Sud			
3.502	Intesa Sanpaolo	9.464	0,04	898	FirstRand	3.527	0,01
3.508	Poste Italiane	39.164	0,18	1.059	Vodacom	6.121	0,03
		68.756	0,31			9.648	0,04
Japon				Corée du Sud			
17.000	Asahi Kasei	109.545	0,50	803	KB Financial	32.867	0,15
7.300	Astellas Pharma	110.608	0,50	197	NAVER	31.970	0,14
1.700	Azbil	56.529	0,26	555	Shinhan Financial	14.928	0,07
100	Bridgestone	3.873	0,02	273	Woori Financial	2.460	0,01
3.200	Daiwa	18.150	0,08			82.225	0,37
100	Fast Retailing	22.907	0,10	Espagne			
800	Hankyu Hanshin	28.627	0,13	8.707	Iberdrola	104.149	0,47
1.400	Honda Motor	45.049	0,21	Suède			
100	Hoya	11.053	0,05	4.795	Tele2	34.082	0,16
2.900	ITOCHU	108.575	0,49	6.557	Telia	13.319	0,06
4.900	KDDI*	145.000	0,66			47.401	0,22
100	Marubeni	1.632	0,01	Suisse			
3.400	MS&AD Insurance	121.898	0,56	1.383	ABB	52.770	0,24
40.000	Nippon Telegraph & Telephone	46.061	0,21	93	DSM-Firmenich	8.601	0,04
100	Omron	4.816	0,02	477	Kuehne + Nagel International	143.606	0,65
500	Panasonic	5.746	0,03	395	Logitech International	27.389	0,12
100	Recruit	3.571	0,02	222	Nestle	26.830	0,12
1.000	SCSK	17.283	0,08	1.005	Novartis	101.955	0,47
5.000	Sega Sammy	99.501	0,45	50	SGS	4.540	0,02
500	SG	7.198	0,03	657	Swiss Re	64.420	0,29
1.700	Shionogi	74.639	0,34	86	Zurich Insurance	40.565	0,19
6.600	SoftBank	75.413	0,34			470.676	2,14
2.400	Sompo	104.224	0,47	Thaïlande			
17.400	Sumitomo Chemical	48.026	0,22	1.500	SCB X	5.055	0,02
1.100	Tokio Marine	24.287	0,11	Turquie			
1.700	Yamada	5.327	0,02	4.322	Turkcell Iletisim Hizmetleri	9.233	0,04
300	Yamaha	9.235	0,04	Royaume-Uni			
1.900	Yamaha Motor	49.127	0,22	1.023	3i	25.826	0,12
		1.357.900	6,17	1.987	Burberry	55.716	0,25
Jersey				160	Diageo	6.644	0,03
119	Ferguson*	19.498	0,09	556	Intertek	29.419	0,13
Mexique				4.849	National Grid	61.321	0,28
798	Grupo Financiero Banorte	7.060	0,03	477	Shell	14.630	0,07
1.777	Wal-Mart de Mexico	7.255	0,04	503	SSE	10.400	0,05
		14.315	0,07			203.956	0,93
Pays-Bas				États-Unis			
52	ASML	34.635	0,16	565	3M	60.822	0,28
2.590	ING Groep	37.188	0,17	630	AbbVie	93.624	0,43
111	Koninklijke Ahold Delhaize	3.653	0,02	338	Adobe	188.509	0,86
35.999	Koninklijke KPN	126.193	0,57	17	Akamai Technologies	1.788	0,01
454	LyondellBasell Industries	45.123	0,21	238	Alphabet	32.804	0,15
90	NXP Semiconductors	18.564	0,08	648	Alphabet	88.608	0,40
240	OCI	6.057	0,03	1.521	Amazon.com	209.533	0,95
303	Prosus	21.180	0,10	39	American Express	6.249	0,03
167	Wolters Kluwer	20.293	0,09	508	Amgen	130.551	0,59
		312.886	1,43	1.330	Apple	250.120	1,14
Norvège				445	Applied Materials	67.618	0,31
936	Equinor	28.883	0,13	5	Arista Networks	960	0,00
12.259	Telenor	131.525	0,60	37	Atlassian	7.608	0,04
		160.408	0,73				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund⁽²⁾

suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	5.611.403	USD	770.067	BNY Mellon	15/9/2023	1.660
USD	155	CNY	1.131	BNY Mellon	15/9/2023	-
Plus-value nette non réalisée						1.660
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	16.196	USD	17.769	BNY Mellon	15/9/2023	(187)
USD	532	EUR	488	BNY Mellon	15/9/2023	2
Moins-value nette non réalisée						(185)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	693.539	USD	88.499	BNY Mellon	15/9/2023	(24)
USD	163	HKD	1.271	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(24)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	121.462	USD	90.231	BNY Mellon	15/9/2023	(328)
USD	40.504	SGD	54.812	BNY Mellon	15/9/2023	(66)
Moins-value nette non réalisée						(394)
Total des plus-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.006.975)						1.057

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
64	USD	Micro E-mini S&P 500 Index	Septembre 2023	1.451.520	19.976
64	USD	Micro E-mini S&P 500 Index	Septembre 2023	1.451.520	22.822
4	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	188.216	(282)
4	EUR	EURO STOXX 50 Index	Septembre 2023	188.216	619
1	GBP	FTSE 100 Index	Septembre 2023	95.048	2.535
6	JPY	Nikkei 225 Index	Septembre 2023	134.077	3.242
14	JPY	Nikkei 225 Index	Septembre 2023	312.846	5.275
1	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	106.805	117
Total				3.928.248	54.304

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(3)	Call	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 33.000	8/9/2023	6.161	(2.361)
(9)	Call	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4.250	15/9/2023	(4.646)	(10.433)
(1)	Call	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 7.350	15/9/2023	(1.374)	(2.133)
(8)	Call	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.415	15/9/2023	(65.008)	(103.960)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 3.416.249)						(64.867)	(118.887)

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund⁽²⁾

suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Fonds d'investissement	32,74
Biens de consommation non cyclique	18,03
Technologie	10,12
Communications	7,02
Finance	6,87
Biens de consommation cyclique	6,55
Valeurs industrielles	5,34
Matériaux de base	2,51
Services aux collectivités	2,41
Énergie	2,06
Diversifiés	0,28
Autres éléments de l'actif net	6,07
	100,00

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.
L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
26.000	Sunac Services*	8.122	0,00	500	Langham Hospitality Investments and Langham Hospitality Investments	57	0,00
154.000	Tianneng Power International*	164.152	0,06	282.000	Shoucheng*	65.799	0,03
332.000	Truly International*	36.828	0,02	388.000	Shougang Fushan Resources	111.805	0,04
39.000	Weimob	20.388	0,01	74.000	Sino-Ocean	3.444	0,00
294.500	Xiabuxiabu Catering Management China	142.313	0,06	56.000	Yuexiu Real Estate Investment Trust	10.496	0,00
23.200	Yeahka	46.146	0,02	11.500	Yuexiu Services	4.633	0,00
		2.465.420	0,96			263.058	0,10
	Chili				Inde		
18.404	Embotelladora Andina	45.775	0,02	6.993	Aavas Financiers	137.890	0,05
	Chine			4.325	Ajanta Pharma	90.244	0,04
140.750	A-Living Smart City Services*	89.730	0,04	7.316	Blue Star	65.435	0,03
46.000	China BlueChemical	11.437	0,01	4.924	Carborundum Universal	67.582	0,03
44.774	Jinzhou Port	9.044	0,00	270	Cera Sanitaryware	31.007	0,01
812.500	Sinopec Engineering	376.053	0,15	3.138	Cholamandalam Financial	37.302	0,01
20.000	Xinhua Winshare Publishing and Media	14.943	0,01	2.122	CreditAccess Grameen	36.284	0,01
		501.207	0,21	625.491	Equitas Small Finance Bank	683.772	0,27
	Danemark			446.531	Federal Bank	776.435	0,30
1.425	FLSmidth	65.104	0,02	11.249	Finolex Industries	32.550	0,01
104.686	H Lundbeck	470.662	0,19	5.847	Global Health	50.107	0,02
182.942	H Lundbeck	930.103	0,36	1.020	Great Eastern Shipping	9.419	0,00
463	Jyske Bank*	33.024	0,01	22.903	Gujarat Pipavav Port	35.937	0,01
		1.498.893	0,58	23.799	ICICI	179.629	0,07
	Finlande			5.403	IDFC	7.946	0,00
5.843	Citycon*	35.849	0,01	41.318	Infibeam Avenues	7.287	0,00
95.908	Finnair	53.536	0,02	80.807	Jyothy Labs	340.022	0,13
4.640	Kemira	73.751	0,03	444.763	Karur Vysya Bank	653.018	0,26
16.038	Kojamo	159.126	0,06	8.030	KEI Industries	262.619	0,10
55.106	Nokian Renkaat*	481.883	0,19	3.517	KPIT Technologies	49.956	0,02
25.948	Outokumpu*	122.152	0,05	44.785	Lemon Tree Hotels	59.101	0,02
		926.297	0,36	38.169	LIC Housing Finance	195.188	0,08
	France			32.565	Mahanagar Gas	402.803	0,16
4.148	Clariane*	28.217	0,01	245.298	Mahindra & Mahindra Financial Services	881.945	0,34
282	Esker	48.524	0,02	62.415	Manappuram Finance	116.557	0,05
15.473	Eutelsat Communications	94.933	0,04	33.143	Max Financial Services	373.801	0,15
5.314	Nexity*	88.787	0,04	1.257	Motilal Oswal Financial Services	13.968	0,00
111.966	Television Francaise 1*	910.470	0,35	4.153	Mrs Bectors Food Specialities	53.842	0,02
		1.170.931	0,46	954	Narayana Hrudayalaya	11.979	0,01
	Allemagne			136.230	NCC	279.088	0,11
284	AIXTRON	10.833	0,01	41.457	Piramal Enterprises	527.463	0,21
2.651	Atoss Software	647.143	0,25	7.187	Praj Industries	42.760	0,02
33.602	Deutsche Pfandbriefbank*	265.402	0,10	2.363	PVR Inox	51.120	0,02
3.670	DIC Asset	17.440	0,01	4.883	Ramkrishna Forgings	42.073	0,02
3.096	ElringKlinger	20.456	0,01	216	Safari Industries India	9.614	0,01
10.567	Freenet	253.827	0,10	1.725	Sun TV Network	12.856	0,00
99	Gerresheimer	12.782	0,01	368	Thermax	12.486	0,01
3.942	HUGO BOSS*	297.755	0,11	3.637	TTK Prestige	34.456	0,01
73.851	Kloekner & Salzgitter*	639.392	0,25	25.802	Ujjivan Small Finance Bank	15.272	0,01
11.222	Salzgitter*	333.115	0,13	12.248	Vardhman Textiles	58.180	0,02
5.427	SMA Solar Technology	440.716	0,17			6.748.993	2,64
91.962	thyssenkrupp	712.584	0,28		Indonésie		
49.665	United Internet	954.821	0,37	6.568.500	Ace Hardware Indonesia	314.839	0,13
		4.606.266	1,80	2.563.500	AKR Corporindo	235.647	0,09
	Grèce			86.800	Bank Tabungan Negara Persero	7.153	0,00
1.419	Aegean Airlines	20.414	0,01	1.905.800	Media Nusantara Citra	65.696	0,03
	Guernesey			9.062.700	Mitra Adiperkasa	1.151.433	0,45
8.417	Shurgard Self Storage	386.283	0,15	3.531.900	Perusahaan Gas Negara	318.868	0,12
	Hong Kong					2.093.636	0,82
30.400	Dah Sing Financial*	66.824	0,03		Irlande		
				27.474	Alkermes	796.197	0,31
				188	Perrigo	6.700	0,00
				5.621	Uniphar	16.649	0,01
						819.546	0,32

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Israël				34.000	Mandom*	334.289	0,13
27.123	Alony Hetz Properties & Investments	203.953	0,08	103.400	Mani*	1.342.421	0,52
36.061	Cellebrite DI*	286.324	0,11	74.000	Marui*	1.277.172	0,50
302	Ituran Location and Control	9.187	0,00	55.600	Mitsubishi Materials*	930.693	0,36
515	Magic Software Enterprises	5.996	0,01	51.300	Nabtesco	968.402	0,38
34.880	Mivne Real Estate KD	83.378	0,03	21.100	NET One Systems	412.169	0,16
1.284	Oddity Tech	54.185	0,02	400	Nippon Ceramic	7.083	0,00
2.217	One Software Technologies	28.608	0,01	2.100	Nippon Light Metal	22.300	0,01
1.836	Partner Communications	7.883	0,00	1.100	Nippon Seiki	8.249	0,00
1.204	Perion Network	39.694	0,02	17.100	Nippon Shinyaku	748.677	0,29
1.981	Plus500	35.835	0,02	7.900	Noritz	86.484	0,03
8.883	ZIM Integrated Shipping Services*	106.596	0,04	900	NSD	15.752	0,01
		861.639	0,34	10.800	Obara*	292.621	0,12
Italie				30.200	Oiles	427.104	0,17
48.784	A2A*	93.603	0,04	12.900	Plus Alpha Consulting	251.636	0,10
30.142	Banca Mediolanum	277.186	0,11	41.900	Prestige International*	168.569	0,07
75.275	Banco BPM	362.856	0,14	4.900	Relo	57.229	0,02
117.950	BPER Banca*	361.001	0,14	4.700	Ricoh Leasing*	137.956	0,05
4.096	Brunello Cucinelli	338.850	0,13	1.600	Sakata INX	14.965	0,01
6.798	Buzzi	203.415	0,08	30.400	Sankyu*	1.057.464	0,42
15.192	Hera	45.986	0,02	300	Sanrio	15.584	0,01
223.984	Iren	461.720	0,18	11.200	Sansan	111.268	0,04
121.588	Maire Tecnimont*	491.256	0,19	100	SCREEN	10.160	0,00
39.233	OVS	98.667	0,04	60.400	Sega Sammy*	1.201.967	0,47
64.019	Piaggio & C	245.740	0,10	43.900	SMS	844.029	0,33
3.249	Reply	330.115	0,13	108.000	Stanley Electric*	1.890.582	0,74
4.125	Sanlorenzo*	164.247	0,06	321.200	Systema*	593.370	0,23
185	Sesa	21.356	0,01	1.000	Taikisha	31.337	0,01
38.944	Webuild*	79.688	0,03	3.000	Takasago Thermal Engineering*	60.162	0,02
		3.575.686	1,40	1.700	Takeuchi Manufacturing	53.970	0,02
Japon				51.800	Takuma*	572.031	0,22
19.800	Adastraia*	394.767	0,15	7.300	Tokai	94.400	0,04
1.400	Aichi	9.138	0,00	196.400	Tokyo Tatemono*	2.573.337	1,01
6.200	Anritsu	45.327	0,02	7.900	Tokyu Construction*	41.512	0,02
3.300	Asics	119.916	0,05	105.000	Tokyu Fudosan*	651.244	0,26
700	Axial Retailing	18.008	0,01	45.900	Tosei	576.282	0,23
65.200	Bunka Shutter*	486.251	0,19	400	Tsubakimoto Chain*	10.537	0,01
5.100	Create SD	130.156	0,05	6	United Urban Investment	6.425	0,00
38.800	Daio Paper*	329.583	0,13			27.069.038	10,60
400	dip	9.579	0,00	Jersey			
47.700	eGuarantee	634.455	0,25	60.346	Centamin	67.555	0,03
20.600	Eiken Chemical*	197.325	0,08	32.718	Man	87.554	0,03
35.100	FCC*	461.820	0,18	8.790	Novocure	191.358	0,07
55.500	Financial Partners*	545.298	0,21			346.467	0,13
5.900	Funai Soken	108.994	0,04	Luxembourg			
9.600	Glory*	202.174	0,08	9.878	Grand City Properties*	88.952	0,04
22.600	H2O Retailing*	271.376	0,11	52.974	SES	387.374	0,15
2.900	Halows	81.055	0,03			476.326	0,19
1.100	Hazama Ando	8.934	0,00	Malaisie			
11.800	Hogy Medical*	258.356	0,10	80.600	Astro Malaysia	8.859	0,00
18.000	Isetan Mitsukoshi*	205.795	0,08	8.500	Carlsberg Brewery Malaysia	37.004	0,01
23.300	Ito En	686.940	0,27	33.100	Heineken Malaysia	169.780	0,07
102.700	J Front Retailing*	1.078.612	0,42	145.500	Lotte Chemical Titan	38.570	0,01
46.700	JAC Recruitment	861.436	0,34	396.200	TIME dotCom	469.634	0,19
5.600	Japan Elevator Service	92.953	0,04			723.847	0,28
2.500	JCU	57.815	0,02	Îles Marshall			
2.300	Joyful Honda	27.004	0,01	3.642	Dorian LPG	92.106	0,04
43.900	Kakaku.com*	521.135	0,21	Mexique			
8.300	Kansai Paint*	135.669	0,05	138.974	Asea	506.885	0,20
24.200	Katitas*	384.968	0,15	2.667	Grupo Aeroportuario del Centro Norte	32.212	0,01
11.300	Kitz	81.567	0,03			539.097	0,21
2.200	Kobe Steel*	27.546	0,01	Pays-Bas			
39.900	Konica Minolta*	122.985	0,05	754	Elastic	47.065	0,02
18.900	Koshidaka*	172.894	0,07	25.026	Just Eat Takeaway.com	356.015	0,14
700	Kureha	40.998	0,02				
113.500	Link And Motivation*	358.777	0,14				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
52.616	MFE-MediaForEurope	37.905	0,02	212	LOTTE Fine Chemical	9.688	0,01
537.290	PostNL*	1.256.798	0,49	2.442	LOTTE Reit	6.291	0,00
3.426	Redcare Pharmacy	407.571	0,16	185	LS Electric	13.969	0,01
		2.105.354	0,83	1.760	NHN	34.621	0,01
	Norvège			21.759	NHN KCP	149.807	0,06
89.202	Aker Solutions	371.924	0,15	4.811	SøAH Besteel	85.901	0,03
15.891	Austevoll Seafood*	115.203	0,04	3.772	Seoul Semiconductor	33.703	0,01
116.823	DNO	109.814	0,04	795	Studio Dragon	31.036	0,01
10.280	Grieg Seafood	72.547	0,03			4.284.496	1,68
13.688	Hoegh Autoliners	95.183	0,04		Espagne		
18.930	SpareBank 1 Nord Norge	169.055	0,07	865.621	Banco de Sabadell	1.012.405	0,40
15.253	SpareBank 1 SMN	202.249	0,08	131.315	Bankinter	849.974	0,33
5.081	SpareBank 1 SR-Bank	61.360	0,02	1.864	Merlin Properties Socimi	16.795	0,01
9.323	Wallenius Wilhelmsen	75.249	0,03	7.901	Pharma Mar	308.255	0,12
		1.272.584	0,50			2.187.429	0,86
	Philippines				Suède		
75.240	Cebu Air	47.972	0,02	35.288	AddTech	600.035	0,24
	Pologne			32.795	Betsson	369.819	0,14
12.640	Bank Millennium	18.688	0,01	9.978	Camurus	268.172	0,11
58.762	Orange Polska	102.229	0,04	1.796	Fortnox	9.377	0,00
		120.917	0,05	3.623	INVISIO	70.074	0,03
	Portugal			948	MIPS	35.203	0,01
1.888	NOS SGPS	7.112	0,00	1.917	Mycronic	39.784	0,01
	Arabie Saoudite			12.486	Resurs	27.354	0,01
2.040	Al Hammadi	29.262	0,01	7.535	SSAB*	43.487	0,02
	Singapour			16.479	Thule*	478.090	0,19
82.806	Capitaland India Trust	71.062	0,03	7.665	Trelleborg*	196.662	0,08
8.200	First Resources	9.403	0,01	1.386	Xvivo Perfusion	37.034	0,01
48.051	Flex	1.338.941	0,52			2.175.091	0,85
62.700	Frasers Centrepoint Trust	103.904	0,04		Suisse		
62.900	Frasers Logistics & Commercial Trust	55.840	0,02	493.994	Aryzta	817.722	0,32
32.600	Keppel DC REIT*	53.058	0,02	6.322	CRISPR Therapeutics	316.353	0,12
		1.632.208	0,64	3.024	Orior	255.421	0,10
	Afrique du Sud			320	PSP Swiss Property	38.804	0,02
32.076	Equites Property Fund	21.372	0,01	4.279	Sulzer*	436.035	0,17
13.434	Investec*	79.203	0,03	430	Tecan	171.667	0,07
600.426	KAP	78.608	0,03	694	Ypsomed*	200.372	0,08
7.325	Motus	39.381	0,02			2.236.374	0,88
16.756	Truworths International	63.395	0,02		Taiwan		
		281.959	0,11	22.000	Asia Vital Components	231.077	0,09
	Corée du Sud			1.000	ASMedia Technology	30.867	0,01
4.795	AfreecaTV	296.388	0,12	5.000	Chicony Electronics	16.250	0,01
31.233	AMOREPACIFIC	795.151	0,31	101.000	Chroma ATE	888.009	0,35
6.790	BNK Financial	35.035	0,01	10.000	Clevo	9.891	0,01
10.268	CJ ENM	452.126	0,18	1.000	ECOVE Environment	9.781	0,00
10.900	CJ Logistics	650.660	0,25	30.000	Elite Material	412.133	0,16
17.265	DGB Financial	97.967	0,04	19.000	Everlight Electronics	27.384	0,01
1.229	Dong-A ST	57.277	0,02	205.000	FLEXium Interconnect	585.135	0,23
2.741	Doosan	243.875	0,10	58.000	Formosa Advanced Technologies	71.575	0,03
2.338	ESR Kendall Square REIT	6.943	0,00	506.000	Getac	1.118.565	0,44
3.608	Eugene Technology	93.902	0,04	6.000	King Slide Works	172.389	0,07
4.936	GS Engineering & Construction	54.261	0,02	744.000	King Yuan Electronics	1.794.205	0,70
2.032	Handsome	29.179	0,01	202.000	Macronix International	213.756	0,08
5.163	Hanwha Life Insurance	9.824	0,00	8.000	Makalot Industrial	84.028	0,03
18.945	Hanwha Systems	192.496	0,07	3.000	Phison Electronics	39.894	0,02
3.344	HL Mando	106.006	0,04	21.504	Poya International	328.166	0,13
539	Hugel	45.836	0,02	296.000	Primax Electronics	616.231	0,24
19.689	Hyundai Marine & Fire Insurance	450.609	0,18	10.000	Shin Zu Shing	25.968	0,01
12.493	K Car	113.990	0,05	15.000	Sinbon Electronics	146.013	0,06
197	KCC	32.566	0,01	6.000	Taiwan Union Technology	23.550	0,01
131	KIWOOM	10.238	0,01	347.000	Teco Electric and Machinery	543.711	0,21
14.758	Koh Young Technology	145.151	0,06	185.000	Tong Yang Industry	394.438	0,15
				11.000	United Integrated Services	75.126	0,03
				22.000	UPC Technology	10.397	0,00
				2.000	Wowprime	17.459	0,01
						7.885.998	3,09

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Thaïlande				3.064	RS	29.511	0,01
544.500	Ananda Development*	12.439	0,01	22.746	Safestore	249.125	0,10
4.600	MK Restaurants	6.240	0,00	16.199	Shaftesbury Capital*	24.087	0,01
318.100	Pruksa	121.726	0,05	1.528	Smart Metering Systems*	13.159	0,01
217.900	Sappe	622.260	0,24	9.401	Softcat	179.473	0,07
779.700	Sappe	2.226.600	0,87	7.798	Spectris*	329.669	0,13
11.800	TQM Alpha	10.278	0,00	2.538	TBC Bank*	91.371	0,04
		2.999.543	1,17	6.997	TechnipFMC	133.083	0,05
Turquie				1.420	Telecom Plus	28.693	0,01
55.161	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii	218.895	0,09	21.234	Travis Perkins*	232.996	0,09
6.526	Dogus Otomotiv Servis ve Ticaret	68.430	0,03	51.022	Tritax Big Box REIT*	91.908	0,04
471.120	Enerjisa Enerji	907.353	0,35	49.847	Vesuvius*	278.631	0,11
2.822	Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret	11.124	0,00	137.344	Virgin Money UK*	286.227	0,11
4.984	Turk Traktor ve Ziraat Makineleri	157.157	0,06	29.728	Wickes	52.758	0,02
		1.362.959	0,53	1.558	YouGov*	17.202	0,01
						8.149.903	3,20
Royaume-Uni				États-Unis			
3.971	Advanced Medical Solutions	12.937	0,01	8.010	1 Automotive*	2.131.942	0,84
1.747	AJ Bell*	6.440	0,00	2.078	2U	6.712	0,00
39.981	Ashmore*	99.691	0,04	17.473	Accel Entertainment	206.181	0,08
4.027	Aston Martin Lagonda Global	17.969	0,01	5.792	ACI Worldwide	144.163	0,06
11.780	Bank of Georgia	521.905	0,21	6.266	Adaptive Biotechnologies*	42.859	0,02
3.709	Bellway	101.275	0,04	112	Addus HomeCare	10.013	0,00
29.417	Big Yellow*	400.500	0,16	136	Advanced Drainage Systems	17.441	0,01
13.810	Ceres Power	60.451	0,02	402	AGCO	52.686	0,02
14.829	Chemring	54.514	0,02	1.202	Agree Realty	74.680	0,03
10.273	ConvaTec	30.447	0,01	1.434	Alaska Air	60.558	0,02
2.067	Cranswick*	88.354	0,03	26.214	Alcoa	790.352	0,31
18.127	Crest Nicholson	41.339	0,02	46.334	Alector	263.177	0,10
501.151	Currys	315.101	0,13	37.360	Allogene Therapeutics	144.210	0,06
1.988	CVS	52.922	0,02	16.952	Amalgamated Financial*	305.136	0,12
10.134	Diploma*	404.404	0,16	22.910	American Assets Trust	492.565	0,19
1.023	DiscoverIE	9.454	0,00	739	AnaptysBio	14.780	0,01
42.002	Dunelm	619.758	0,24	6.661	Antero Resources	180.646	0,07
3.234	Essentra	6.051	0,00	58.970	Anywhere Real Estate	398.637	0,16
6.678	Ferrexpo	6.611	0,00	35.089	Apogee Enterprises	1.769.889	0,69
16.099	Firstgroup	29.714	0,01	76.433	Archrock	978.342	0,38
110.790	Forterra	235.382	0,09	14.835	Armstrong World Industries	1.152.828	0,45
1.040	Genus	30.771	0,01	10.113	Arvinas	278.613	0,11
5.946	Greggs	185.572	0,07	1.789	Asbury Automotive*	410.701	0,16
25.843	Hammerson*	7.836	0,00	2.925	Atkore*	450.450	0,18
8.907	Hill & Smith*	200.979	0,08	1.604	AtriCure	74.121	0,03
2.590	Howden Joinery*	24.342	0,01	3.989	AutoNation	635.607	0,25
24.660	Hunting	75.962	0,03	3.835	Avidity Biosciences	30.603	0,01
14.339	IG*	122.785	0,05	1.154	Avnet	59.016	0,02
1.001	IMI	19.085	0,01	2.645	Axcelis Technologies	503.873	0,20
15.080	Impax Asset Management*	102.080	0,04	3.129	Axonics*	182.108	0,07
15.463	Investec*	92.167	0,04	18.176	AZEK	610.714	0,24
4.378	Jupiter Fund Management	5.495	0,00	2.828	Badger Meter	472.276	0,19
7.415	Kainos	114.299	0,04	1.295	Bank OZK	52.266	0,02
4.961	LXI REIT*	5.890	0,00	15.316	Beam Therapeutics*	357.322	0,14
93.030	Marks & Spencer	268.643	0,11	4.593	Beazer Homes USA	133.518	0,05
7.993	Marshalls	27.965	0,01	3.985	Blueprint Medicines*	197.576	0,08
7.100	Moneysupermarket.com*	22.627	0,01	4.925	Boise Cascade	537.564	0,21
6.262	Morgan Sindall*	155.268	0,06	23.338	Boyd Gaming*	1.558.978	0,61
34.793	OSB*	150.664	0,06	5.252	Brandywine Realty Trust	26.733	0,01
5.765	Oxford Biomedica*	23.532	0,01	273	Bristow	7.592	0,00
8.653	Paragon Banking	57.861	0,02	8.756	Bruker	582.449	0,23
5.142	Pennon	42.108	0,02	21.895	Bumble	361.049	0,14
11.976	Pets at Home	57.278	0,02	214	Cable One	141.921	0,06
5.576	QinetiQ	23.806	0,01	291	CACI International	95.951	0,04
117.158	Quilter	125.124	0,05	4.467	Calix	206.241	0,08
337	Rathbones	7.519	0,00	30.742	CareTrust REIT	624.678	0,24
1.261	Redrow	7.610	0,00	2.170	Cava*	96.793	0,04
117.937	Rightmove	844.392	0,33	5.497	Century Communities*	407.218	0,16
51.106	Rotork	195.131	0,08	24.025	Cerus	46.849	0,02
				51.229	Chegg	516.388	0,20
				1.945	Chemed*	999.711	0,39

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾ suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
2.811	Chord Energy	449.184	0,18	11.778	Harmony Biosciences	419.061	0,16
29.343	Ciena	1.439.274	0,56	10.584	Heartland Express	160.559	0,06
3.422	Cirrus Logic	279.680	0,11	47.780	Helix Energy Solutions*	486.400	0,19
1.932	Clear Secure	42.774	0,02	476	Highwoods Properties	11.391	0,00
5.604	Clearwater Analytics	101.545	0,04	4.138	Howard Hughes	327.730	0,13
43.534	Clearway Energy	1.026.096	0,40	71.494	Huntsman	1.993.253	0,78
4.381	Clearway Energy	109.306	0,04	2.595	IGM Biosciences	18.814	0,01
8.288	CNX Resources	182.916	0,07	14.805	Inari Medical*	1.030.132	0,40
21.406	Columbia Banking System*	444.817	0,17	114.229	Independence Realty Trust*	1.939.608	0,76
6.987	Comfort Systems USA*	1.280.787	0,50	8.296	Independent Bank	351.875	0,14
12.066	CommVault Systems	837.501	0,33	3.548	Insperty	359.341	0,14
2.437	Compass	8.846	0,00	6.396	Inspire Medical Systems	1.497.815	0,59
78.029	Corcept Therapeutics	2.564.033	1,00	1.413	Installed Building Products	203.557	0,08
830	Corporate Office Properties Trust	21.646	0,01	4.591	Intellia Therapeutics	173.218	0,07
30.254	CSG Systems International	1.679.097	0,66	475	Intra-Cellular Therapies	26.628	0,01
5.547	Curtiss-Wright	1.159.323	0,45	1.690	Iridium Communications	82.371	0,03
917	Cytokinetics	32.581	0,01	19.409	Ironwood Pharmaceuticals*	177.204	0,07
1.273	Deciphera Pharmaceuticals	18.191	0,01	1.403	iTeos Therapeutics	17.117	0,01
19.756	Denny's	191.041	0,07	1.718	Itron	118.078	0,05
5.368	Digi International	179.721	0,07	8.115	ITT*	827.568	0,32
759	Dime Community Bancshares	16.470	0,01	93.015	JetBlue Airways*	557.625	0,22
18.484	DISH Network*	111.551	0,04	290	Karuna Therapeutics	53.682	0,02
10.898	DoubleVerify*	368.570	0,14	16.009	KB Home	811.656	0,32
5.505	Dril-Quip	151.277	0,06	18.201	Kennametal	491.427	0,19
9.689	DT Midstream	508.576	0,20	3.418	Kilroy Realty	126.261	0,05
12	EastGroup Properties	2.163	0,00	3.748	Koppers	145.460	0,05
1.040	EchoStar	18.106	0,01	33.918	Korn Ferry	1.761.701	0,69
1.346	Editas Medicine	12.127	0,01	48.145	Kulicke & Soffa Industries	2.547.833	1,00
48.915	Elanco Animal Health	611.927	0,24	48.138	Kura Oncology	477.529	0,19
8.810	Embecta*	160.518	0,06	358	Kymera Therapeutics	6.960	0,00
5.157	EMCOR	1.162.955	0,46	4.921	Lamar Advertising	449.829	0,18
18.487	Emergent BioSolutions	91.141	0,04	280	Lantheus	18.897	0,01
5.773	Enanta Pharmaceuticals	88.904	0,04	60.070	Laureate Education	835.574	0,33
2.451	Encore Wire	405.665	0,16	42.470	Legalzoom.com	484.583	0,19
35.379	Enovis	1.998.913	0,78	40.108	Leggett & Platt	1.136.260	0,45
1.398	Envista	45.575	0,02	866	LeMaitre Vascular	50.826	0,02
7.157	Erasca	18.966	0,01	671	Ligand Pharmaceuticals	43.977	0,02
292	Euronet Worldwide	25.623	0,01	14.310	Louisiana-Pacific*	900.528	0,35
43.470	Everi*	630.098	0,25	27.824	Lumen Technologies	43.684	0,02
9.982	eXp World*	194.250	0,08	8.206	LXP Industrial Trust	80.747	0,03
229	Exponent	20.944	0,01	11.646	Magnolia Oil & Gas*	266.228	0,10
3.983	Extreme Networks	107.421	0,04	559	Matson	49.494	0,02
32.735	EZCORP	276.938	0,11	2.928	MaxLinear	67.666	0,03
42.637	Fate Therapeutics	111.709	0,04	1.985	McGrath RentCorp	203.760	0,08
1.048	Federal Realty Investment Trust*	103.333	0,04	14.087	MDC*	670.400	0,26
16.491	Federal Signal	1.013.702	0,40	63.136	Medical Properties Trust	458.367	0,18
433	Federated Hermes	15.064	0,01	3.862	Medpace*	1.050.078	0,41
30.008	First Interstate BancSystem*	775.107	0,30	5.380	Methode Electronics	176.087	0,07
4.211	Five Below	742.147	0,29	24.988	Midland States Bancorp*	553.234	0,22
3.068	Flowers Foods	72.435	0,03	9.248	Mister Car Wash	67.695	0,03
14.888	Flowserve	589.416	0,23	23.390	Model N*	637.611	0,25
2.072	Forrester Research*	64.626	0,03	3.210	Monro	107.984	0,04
684	Franklin Covey	30.014	0,01	14.753	MP Materials*	309.075	0,12
1.273	Gentherm	76.533	0,03	3.801	Murphy Oil	173.250	0,07
4.796	Getty Realty	144.887	0,06	54	MYR	7.717	0,00
780	Gibraltar Industries	58.672	0,02	1.576	Natera*	92.637	0,04
188	Globus Medical	10.191	0,00	32.840	National Fuel Gas	1.749.387	0,69
720	GMS	51.754	0,02	4.110	National Vision	76.610	0,03
2.615	Grand Canyon Education	306.766	0,12	814	Neogen*	18.869	0,01
10.508	Grocery Outlet	324.592	0,13	6.092	Nevro	122.510	0,05
277	Guardant Health	10.925	0,00	3.967	NexPoint Residential Trust	150.587	0,06
609	H&E Equipment Services	27.883	0,01	9.638	NextEra Energy Partners*	483.635	0,19
359	Hackett	8.311	0,00	70.038	NextGen Healthcare*	1.287.999	0,50
178	Haemonetics	16.088	0,01	2.893	Nurix Therapeutics	24.706	0,01
36.439	Hain Celestial*	400.465	0,16	13.672	Olo	87.774	0,03
12.309	Halozyne Therapeutics*	527.933	0,21	11.061	OneMain	457.041	0,18
3.063	HarborOne Bancorp	30.017	0,01	14.060	Oshkosh	1.473.769	0,58
21.608	Harley-Davidson	732.295	0,29	8.787	Palomar*	450.158	0,18
				381	Papa John's International*	29.272	0,01
				1.086	PDF Solutions	39.672	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾ suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	6.748.140	USD	4.392.279	BNY Mellon	15/9/2023	(19.384)
USD	402.384	AUD	623.877	BNY Mellon	15/9/2023	(1.896)
Moins-value nette non réalisée						(21.280)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	6.167.528	USD	7.846.312	BNY Mellon	15/9/2023	(27.652)
USD	414.948	GBP	326.543	BNY Mellon	15/9/2023	985
Moins-value nette non réalisée						(26.667)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 13.007.046)						(47.947)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
27	USD	MSCI EAFE Index	Septembre 2023	2.861.595	7.740
16	USD	MSCI Emerging Markets Index	Septembre 2023	788.240	(6.610)
42	USD	Russell 2000 E-Mini Index	Septembre 2023	4.024.020	22.325
Total				7.673.855	23.455

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	18,68
Valeurs industrielles	17,27
Finance	16,97
Biens de consommation cyclique	15,37
Technologie	10,71
Matériaux de base	5,33
Communications	4,84
Énergie	4,60
Services aux collectivités	3,24
Autres éléments de l'actif net	2,99
	100,00

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations. L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

United Kingdom Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-value non réalisée GBP
GBP	14.668.920	USD	18.535.002	Citigroup	15/9/2023	48.106
Plus-value nette non réalisée						48.106
Total des plus-values nettes non réalisées (GBP Exposition sous-jacente - GBP 14.620.969)						48.106

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	31,83
Finance	19,75
Biens de consommation cyclique	13,47
Communications	9,66
Énergie	9,10
Matériaux de base	5,91
Technologie	5,61
Valeurs industrielles	4,10
Autres éléments de l'actif net	0,57
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Basic Value Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	294.431	USD	40.799	BNY Mellon	15/9/2023	(306)
USD	1.904	CNY	13.844	BNY Mellon	15/9/2023	–
Moins-value nette non réalisée						(306)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	24.150.532	USD	26.494.151	BNY Mellon	15/9/2023	(278.041)
USD	1.413.860	EUR	1.295.933	BNY Mellon	15/9/2023	7.092
Moins-value nette non réalisée						(270.949)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	292.116	USD	216.997	BNY Mellon	15/9/2023	(781)
USD	10.934	SGD	14.794	BNY Mellon	15/9/2023	(16)
Moins-value nette non réalisée						(797)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 27.877.526)						(272.052)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	27,69
Finance	20,09
Technologie	13,36
Énergie	8,59
Communications	7,29
Biens de consommation cyclique	7,16
Valeurs industrielles	6,31
Services aux collectivités	3,79
Matériaux de base	1,09
Autres éléments de l'actif net	4,63
	100,00

US Dollar Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 250.000	Anchorage Capital CLO 2013-1 7,213% 13/10/2030	249.221	0,05
OBLIGATIONS				USD 250.000	Anchorage Capital CLO 3-R 7,127% 28/1/2031	248.226	0,05
Argentine				USD 207.558	Anchorage Capital CLO 4-R 6,677% 28/1/2031	206.148	0,04
USD 46.000	Argentine Republic Government International Bond 3,625% 9/7/2035	13.801	0,00	USD 250.000	Apidos CLO XXIV 6,538% 20/10/2030	248.913	0,05
USD 39.000	Argentine Republic Government International Bond 4,25% 9/1/2038	13.750	0,00	USD 250.000	Apidos CLO XXXI 7,12% 15/4/2031	247.955	0,05
USD 14.000	YPF 6,95% 21/7/2027	11.840	0,00	USD 112.000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2022-FL2 7,16% 15/5/2037	111.216	0,02
USD 79.847	YPF 7% 30/9/2033	61.665	0,01	USD 250.000	Bain Capital Credit CLO 2021-3 8,707% 24/7/2034	238.861	0,04
USD 67.000	YPF 7% 15/12/2047	46.095	0,01	USD 250.000	Bardot CLO 8,607% 22/10/2032	244.870	0,04
		147.151	0,02	USD 500.000	Benefit Street Partners CLO V-B 6,678% 20/4/2031	498.172	0,09
Bénin				USD 200.490	BlueMountain CLO 2013-2 6,787% 22/10/2030	199.802	0,04
EUR 100.000	Benin Government International Bond 4,875% 19/1/2032*	81.334	0,01	USD 673.443	BlueMountain CLO 2015-3 6,588% 20/4/2031	671.205	0,12
Bermudes				USD 250.000	Canyon CLO 2020-3 7,27% 15/1/2034	247.281	0,04
USD 1.620.000	PFP 2022-9 7,587% 19/8/2035	1.617.206	0,29	USD 230.383	Carbone CLO 6,728% 20/1/2031	230.095	0,04
Îles Vierges britanniques				USD 222.760	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-3 6,67% 15/10/2030	222.066	0,04
USD 200.000	RKPF Overseas 2020 A 5,2% 12/1/2026	73.364	0,01	USD 250.000	CBAM 2017-1 7,988% 20/7/2030	248.002	0,05
Canada				USD 250.000	CIFC Funding 2014-II-R 8,407% 24/4/2030	247.535	0,04
USD 4.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,875% 15/1/2028	3.643	0,00	USD 250.000	CIFC Funding 2015-III 6,732% 19/4/2029	246.750	0,04
USD 63.984	Air Canada 2017-1 Class AA Pass Through Trust 3,3% 15/1/2030	56.435	0,01	USD 500.000	CIFC Funding 2017-I 7,295% 23/4/2029	498.555	0,09
USD 31.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 6,25% 15/9/2027	28.688	0,01	USD 840.000	CIFC Funding 2018-I 6,572% 18/4/2031	837.270	0,15
USD 73.000	Enbridge 2,5% 1/8/2033	56.730	0,01	USD 178.436	Clear Creek CLO 6,788% 20/10/2030	177.744	0,03
USD 256.000	Enbridge 5,7% 8/3/2033	256.219	0,04	USD 363.161	Deer Creek CLO 2017-1 6,768% 20/10/2030	361.663	0,07
USD 14.000	Masonite International 5,375% 1/2/2028	13.221	0,00	USD 1.396.639	Dryden 53 CLO 6,69% 15/1/2031	1.393.022	0,25
USD 3.000	Mattamy 5,25% 15/12/2027	2.824	0,00	USD 194.814	Dryden XXVI Senior Loan Fund 6,47% 15/4/2029	194.169	0,04
		417.760	0,07	USD 250.000	Eaton Vance CLO 2018-1 7,77% 15/10/2030	245.850	0,04
Îles Caïmans				USD 200.000	Fantasia 7,95% 5/7/2022***	9.588	0,00
USD 250.000	ACAS CLO 2015-1 7,172% 18/10/2028	246.003	0,04	USD 465.639	Flatiron CLO 18 6,52% 17/4/2031	463.794	0,08
USD 320.000	AGL CLO 12 6,748% 20/7/2034	317.680	0,06	USD 200.000	Gaci First Investment 4,75% 14/2/2030	194.425	0,03
USD 270.000	AGL CLO 14 6,745% 2/12/2034	266.637	0,05	USD 250.000	Galaxy XXII CLO 6,77% 16/4/2034	246.648	0,04
USD 250.000	AGL CLO 3 8,87% 15/1/2033	247.202	0,04	USD 245.556	Generate CLO 2 6,757% 22/1/2031	244.160	0,04
USD 250.000	AGL CLO 7 6,77% 15/7/2034	246.646	0,04	USD 250.000	Gilbert Park CLO 7,52% 15/10/2030	247.592	0,04
USD 500.000	AGL Core CLO 4 6,658% 20/4/2033	496.725	0,09	USD 250.000	Gilbert Park CLO 8,52% 15/10/2030	240.851	0,04
USD 250.000	AIMCO CLO Series 2015-A 7,17% 17/10/2034	247.686	0,04	USD 1.563.000	Goldentree Loan Opportunities X 6,708% 20/7/2031	1.559.940	0,28
USD 250.000	AIMCO CLO Series 2017-A 6,638% 20/4/2034	247.675	0,04	USD 1.161.392	Goldentree Loan Opportunities XI 6,642% 18/1/2031	1.158.937	0,21
USD 250.000	AIMCO CLO Series 2017-A 7,688% 20/4/2034	243.863	0,04	USD 740.000	Goldentree Loan Management US CLO 1 6,718% 20/10/2034	735.375	0,13
USD 132.936	Allegro CLO II-S 6,675% 21/10/2028	132.629	0,02				
USD 250.000	Allegro CLO XI 7,432% 19/1/2033	247.472	0,04				
USD 225.362	AMMC CLO 21 6,877% 2/11/2030	224.770	0,04				
USD 206.851	Anchorage Capital CLO 2013-1 6,813% 13/10/2030	206.281	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 152.419	Grippen Park CLO 6,848% 20/1/2030	152.277	0,03	COP 676.000.000	Colombian TES 7,5% 26/8/2026	155.115	0,03
USD 250.000	LCM XIV 6,628% 20/7/2031	247.666	0,04	USD 371.000	Ecopetrol 6,875% 29/4/2030	345.122	0,06
USD 238.731	Loanpal Solar Loan 2021-1 2,29% 20/1/2048	176.621	0,03	USD 29.000	Ecopetrol 8,875% 13/1/2033	29.363	0,01
USD 198.376	Madison Park Funding XIII 6,532% 19/4/2030	197.919	0,04			619.744	0,11
USD 750.000	Madison Park Funding XLI 7,257% 22/4/2027	746.656	0,14		Côte d'Ivoire		
USD 362.998	Madison Park Funding XXVI 6,831% 29/7/2030	362.055	0,07	EUR 100.000	Ivory Coast Government International Bond 4,875% 30/1/2032	83.932	0,02
USD 213.426	MP CLO III 6,838% 20/10/2030	213.195	0,04		Égypte		
USD 487.054	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 6,492% 18/10/2030	484.773	0,09	USD 200.000	Egypt Government International Bond 7,625% 29/5/2032	115.247	0,02
USD 250.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 6,972% 18/10/2030	247.790	0,05		Allemagne		
USD 810.068	OHA Loan Funding 2013-2 6,679% 23/5/2031	805.007	0,15	USD 643.000	Deutsche Bank 5,371% 9/9/2027	639.439	0,12
USD 469.862	OZLM XVIII 6,59% 15/4/2031	465.611	0,08	USD 159.000	Deutsche Bank 6,72% 18/1/2029	161.031	0,03
USD 596.484	Palmer Square CLO 2014-1 6,7% 17/1/2031	595.754	0,11			800.470	0,15
USD 236.204	Palmer Square CLO 2018-1 6,602% 18/4/2031	235.319	0,04		Inde		
USD 350.000	Palmer Square CLO 2018-2 6,67% 16/7/2031	349.331	0,06	USD 500.000	Export-Import Bank of India 3,875% 12/3/2024	494.985	0,09
USD 250.000	Pikes Peak CLO 1 6,787% 24/7/2031	248.421	0,05		Indonésie		
USD 600.000	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4% 24/8/2040	537.724	0,10	USD 200.000	Indonesia Government International Bond 2,85% 14/2/2030	175.767	0,03
USD 260.000	Riserva CLO 6,632% 18/1/2034	257.335	0,05	USD 401.000	Indonesia Government International Bond 3,05% 12/3/2051*	285.993	0,05
USD 1.647.461	Rockford Tower CLO 2017-3 6,778% 20/10/2030	1.645.402	0,30	IDR 863.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,375% 15/8/2028	57.146	0,01
USD 725.742	Rockford Tower CLO 2018-1 6,741% 20/5/2031	723.384	0,13	IDR 625.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,25% 15/5/2029	44.793	0,01
USD 500.000	Rockford Tower CLO 2018-1 7,361% 20/5/2031	493.763	0,09	IDR 408.000.000	Indonesia Treasury Bond 9% 15/3/2029	30.111	0,01
USD 250.000	Rockford Tower CLO 2018-2 6,748% 20/10/2031	249.187	0,05			593.810	0,11
USD 458.434	Romark WM-R 6,618% 20/4/2031	455.543	0,08		Irlande		
USD 250.000	RR 19 12,07% 15/10/2035	251.209	0,05	EUR 250.000	Alme Loan Funding V 9,073% 15/7/2031	264.684	0,05
USD 224.946	RR 3 6,66% 15/1/2030	224.558	0,04	EUR 297.000	Ares European CLO XII 5,405% 20/4/2032	315.875	0,06
USD 250.000	RR 5 7,22% 15/10/2031	247.808	0,05	EUR 100.000	Avoca CLO XV 4,713% 15/4/2031	104.655	0,02
USD 237.041	Signal Peak CLO 5 6,723% 25/4/2031	236.745	0,04	EUR 500.000	Avoca CLO XVIII 5,413% 15/4/2031	527.957	0,09
USD 250.000	Symphony CLO XXVI 6,668% 20/4/2033	247.868	0,05	EUR 100.000	Avoca CLO XXII 4,963% 15/4/2035	104.188	0,02
USD 226.213	Tiaa CLO III 6,72% 16/1/2031	225.751	0,04	EUR 250.000	Avoca CLO XXIII 6,713% 15/4/2034	254.213	0,04
USD 1.130.281	TICP CLO IX 6,728% 20/1/2031	1.127.493	0,20	EUR 250.000	Avoca CLO XXIII 6,713% 15/4/2034	256.108	0,05
USD 250.000	TICP CLO XI 6,768% 20/10/2031	249.622	0,05	EUR 250.000	Bluemountain Euro 2021-2 CLO 5,413% 15/10/2035	264.360	0,05
USD 150.000	TRINITAS CLO IV 6,972% 18/10/2031	147.235	0,03	EUR 300.000	BlueMountain Fuji CLO III 6,563% 15/1/2031	309.039	0,05
USD 500.000	Trinitas CLO XIV 7,613% 25/1/2034	494.254	0,09	EUR 100.000	CIFC European Funding CLO II 5,263% 15/4/2033	105.890	0,02
USD 743.166	Voya CLO 2014-4 6,673% 14/7/2031	740.447	0,13	EUR 250.000	CVC Cordatus Loan Fund IV 5,116% 22/2/2034	259.811	0,05
USD 417.938	Voya CLO 2017-4 6,7% 15/10/2030	416.533	0,08	EUR 250.000	CVC Cordatus Loan Fund V 5,146% 21/7/2030	266.719	0,05
USD 250.000	Wellfleet CLO 2017-3 7,52% 17/1/2031	243.316	0,04	EUR 250.000	Euro-Galaxy III CLO 6,948% 24/4/2034	262.176	0,05
		31.530.742	5,69	EUR 250.000	Fidelity Grand Harbour CLO 2021-1 7,263% 15/10/2034	253.241	0,04
				EUR 100.000	Henley CLO IV 5,071% 25/4/2034	104.855	0,02
	Colombie			EUR 250.000	Henley CLO IV 6,721% 25/4/2034	255.063	0,04
COP 430.000.000	Colombian TES 5,75% 3/11/2027	90.144	0,01	EUR 250.000	Madison Park Euro Funding XVI 6,863% 25/5/2034	255.348	0,05

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 250.000	Man GLG Euro CLO VI 7,163% 15/10/2032	258.147	0,05	USD 352.000	Panama Panama Government International Bond 3,875% 17/3/2028	331.403	0,06
EUR 100.000	OCP Euro CLO 2017-2 5,013% 15/1/2032	106.366	0,02	USD 445.000	Panama Government International Bond 4,5% 1/4/2056	322.120	0,06
EUR 250.000	Penta CLO 11 6,231% 15/11/2034	269.845	0,05			653.523	0,12
GBP 179.262	Scorpio European Loan Conduit No. 34 7,1% 17/5/2029	222.394	0,04	USD 324.000	Pérou Peruvian Government International Bond 3,55% 10/3/2051	232.653	0,04
EUR 100.000	St Paul's CLO XII 5,263% 15/4/2033	105.100	0,02	USD 552.000	Philippines Philippine Government International Bond 3% 1/2/2028	509.399	0,09
		5.126.034	0,93	USD 282.000	Philippine Government International Bond 3,2% 6/7/2046	201.200	0,04
	Israël					710.599	0,13
USD 5.000	Energian Israel Finance 8,5% 30/9/2033*	5.069	0,00	USD 200.000	Pologne Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375% 22/5/2033	196.250	0,04
USD 2.000	Leviathan Bond 6,75% 30/6/2030*	1.878	0,00	EUR 59.000	Roumanie Romanian Government International Bond 2,125% 7/3/2028	56.332	0,01
		6.947	0,00	RUB 12.015.000	Fédération de Russie Russian Federal Bond - OFZ 6,1% 18/7/2035	35.056	0,01
	Italie			USD 403.000	Singapour Pfizer Investment Enterprises 4,75% 19/5/2033	396.970	0,07
EUR 196.549	Cassia 2022-1 5,883% 22/5/2034	204.267	0,04	USD 773.000	Pfizer Investment Enterprises 5,3% 19/5/2053	774.602	0,14
USD 417.000	Japon Takeda Pharmaceutical 2,05% 31/3/2030	342.917	0,06	USD 160.000	Pfizer Investment Enterprises 5,34% 19/5/2063	158.018	0,03
USD 198.000	Luxembourg Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	1.980	0,00			1.329.590	0,24
USD 8.000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	80	0,00	USD 772.000	Suisse Credit Suisse 3,7% 21/2/2025	743.751	0,13
USD 180.000	Millicom International Cellular 6,625% 15/10/2026*	176.177	0,03	USD 512.000	Credit Suisse 5% 9/7/2027	497.479	0,09
USD 200.000	Tupy Overseas 4,5% 16/2/2031	161.935	0,03	USD 784.000	Credit Suisse 7,5% 15/2/2028	836.609	0,15
		340.172	0,06	USD 1.130.000	Credit Suisse 7,95% 9/1/2025	1.151.992	0,21
USD 38.703	Mexique Grupo Posadas 5% 30/12/2027	33.194	0,01	USD 768.000	UBS 2,746% 11/2/2033	604.610	0,11
MXN 2.500.000	Mexican Bonos 7,5% 3/6/2027	139.171	0,03	USD 253.000	UBS 3,75% 26/3/2025	244.560	0,04
MXN 9.480.000	Mexican Bonos 8,5% 31/5/2029	544.111	0,10			4.079.001	0,73
MXN 3.499.600	Mexican Bonos 8,5% 18/11/2038	193.356	0,03	USD 69.895	Turquie Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 4,2% 15/3/2027	64.901	0,01
MXN 85.200.000	Mexico Cetes 0% 28/11/2024	445.741	0,08	USD 46.000	Ukraine Ukraine Government International Bond 7,75% 1/8/2041	21.160	0,00
USD 544.000	Mexico Government International Bond 2,659% 24/5/2031	450.470	0,08	USD 430.000	Royaume-Uni Anglo American Capital 3,875% 16/3/2029	392.534	0,07
USD 919.000	Mexico Government International Bond 4,5% 31/1/2050*	730.430	0,13	USD 559.000	Anglo American Capital 5,5% 2/5/2033*	539.969	0,10
USD 34.000	Petroleos Mexicanos 4,875% 18/1/2024	33.688	0,00	USD 62.461	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	54.713	0,01
USD 178.000	Petroleos Mexicanos 6,875% 4/8/2026	162.490	0,03	USD 2.045.000	BAE Systems 3,4% 15/4/2030	1.827.736	0,33
MXN 806.800	Petroleos Mexicanos 7,19% 12/9/2024	45.147	0,01				
USD 66.000	Petroleos Mexicanos 8,75% 2/6/2029	59.054	0,01				
		2.836.852	0,51				
USD 200.000	Maroc Morocco Government International Bond 6,5% 8/9/2033	201.335	0,04				
USD 230.000	Pays-Bas NXP / NXP Funding / NXP USA 4,3% 18/6/2029	215.403	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 447.000	Barclays 6,224% 9/5/2034	441.494	0,08	USD 42.000	Altria 3,4% 4/2/2041	28.651	0,01
USD 84.271	SCC Power 4% 17/5/2032	9.060	0,00	USD 395.000	Altria 4,5% 2/5/2043	308.642	0,06
USD 70.620	SCC Power 8% 31/12/2028	26.306	0,01	USD 159.000	Altria 5,375% 31/1/2044*	147.858	0,03
		3.291.812	0,60	USD 117.000	Altria 5,8% 14/2/2039	114.242	0,02
				USD 45.652	Ambac Assurance 5,1% 31/12/9999	66.428	0,01
	États-Unis			USD 146.000	Ameren Illinois 3,25% 15/3/2050	103.169	0,02
USD 552.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	486.954	0,09	USD 139.000	Ameren Illinois 5,9% 1/12/2052	146.883	0,03
USD 200.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	168.581	0,03	USD 182.955	American Airlines 2015-2 Class B Pass Through Trust 4,4% 22/9/2023	182.578	0,03
USD 100.000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4,28% 10/8/2035	90.595	0,02	USD 21.960	American Airlines 2017-1 Class AA Pass Through Trust 3,65% 15/2/2029	20.132	0,00
USD 100.000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P 3,779% 5/6/2037	78.479	0,01	USD 36.310	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 5,13% 25/2/2047	14.496	0,00
USD 210.000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P 3,779% 5/6/2037	162.818	0,03	USD 276.078	American Home Mortgage Investment Trust 2007-1 5,619% 25/5/2047	161.772	0,03
USD 200.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 6,902% 15/9/2034	180.559	0,03	USD 170.000	American Municipal Power 8,084% 15/2/2050	226.155	0,04
USD 210.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 7,485% 15/9/2034	186.450	0,03	USD 117.000	American Tower 2,1% 15/6/2030	93.408	0,02
USD 888.000	AbbVie 4,5% 14/5/2035	835.308	0,15	USD 620.000	American Tower 2,3% 15/9/2031	485.480	0,09
USD 136.000	AbbVie 4,55% 15/3/2035	128.694	0,02	USD 425.000	American Tower 2,7% 15/4/2031	347.690	0,06
USD 224.000	AbbVie 4,875% 14/11/2048	207.158	0,04	USD 463.000	American Tower 3,8% 15/8/2029	420.841	0,08
USD 134.000	AEP Texas 3,45% 15/1/2050	93.036	0,02	USD 323.000	American Tower 3,95% 15/3/2029	296.700	0,05
USD 273.000	AEP Texas 3,45% 15/5/2051	184.855	0,03	USD 126.000	American Tower 5,55% 15/7/2033	124.620	0,02
USD 164.000	AEP Texas 3,8% 1/10/2047	119.060	0,02	USD 417.000	American Transmission Systems 2,65% 15/1/2032	341.744	0,06
USD 384.000	AEP Texas 3,95% 1/6/2028	360.664	0,06	USD 876.000	Amgen 4,4% 22/2/2062	697.030	0,13
USD 277.000	AEP Texas 5,4% 1/6/2033	273.974	0,05	USD 1.028.000	Amgen 5,25% 2/3/2030	1.029.834	0,19
USD 158.000	AEP Transmission 2,75% 15/8/2051	98.318	0,02	USD 326.000	Amgen 5,75% 2/3/2063	322.219	0,06
USD 480.000	AEP Transmission 3,8% 15/6/2049	370.670	0,06	USD 87.000	Aon 2,8% 15/5/2030	74.848	0,01
USD 144.000	AEP Transmission 4,5% 15/6/2052	124.518	0,02	USD 496.000	Aon / Aon Global 5,35% 28/2/2033	495.056	0,09
USD 57.305	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-C 2,25% 27/9/2060	56.354	0,01	USD 101.000	Apache 4,75% 15/4/2043	77.211	0,01
USD 350.625	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-D 2,25% 25/6/2060	342.224	0,06	USD 1.975.364	APS Resecuritization Trust 2016-1 2,978% 31/7/2057	669.514	0,12
USD 1.195.748	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-C 2,115% 25/1/2061	1.138.967	0,21	USD 39.275	APS Resecuritization Trust 2016-3 8,279% 27/9/2046	39.414	0,01
USD 150.000	Alabama Power 3% 15/3/2052	97.420	0,02	USD 650.000	AREIT 2022-CRE7 7,556% 17/6/2039	650.256	0,12
USD 107.000	Alabama Power 3,45% 1/10/2049	76.175	0,01	USD 133.508	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 5,909% 25/5/2035	116.825	0,02
USD 222.000	Alabama Power 3,75% 1/3/2045	169.502	0,03	USD 95.000	Ashford Hospitality Trust 2018- ASHF 7,583% 15/4/2035	91.363	0,02
USD 5.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,875% 15/2/2030	4.594	0,00	USD 227.000	Ashford Hospitality Trust 2018- ASHF 8,583% 15/4/2035	220.794	0,04
USD 243.753	Alternative Loan Trust 2004- 22CB 6,25% 25/10/2034	241.596	0,04	USD 164.000	AT&T 3,5% 15/9/2053	107.969	0,02
USD 308.871	Alternative Loan Trust 2006- OA14 6,16% 25/11/2046	239.988	0,04	USD 773.000	AT&T 3,55% 15/9/2055	503.194	0,09
USD 368.103	Alternative Loan Trust 2006- OA16 5,809% 25/10/2046	333.994	0,06	USD 537.000	AT&T 3,65% 15/9/2059	348.138	0,06
USD 66.826	Alternative Loan Trust 2006- OA9 5,628% 20/7/2046	53.443	0,01	USD 416.000	AT&T 3,8% 1/12/2057	281.079	0,05
USD 64.802	Alternative Loan Trust 2006- OC10 5,889% 25/11/2036	56.038	0,01	USD 96.000	AT&T 3,85% 1/6/2060	65.494	0,01
USD 488.755	Alternative Loan Trust 2007- 14T2 6% 25/7/2037	246.044	0,04	USD 557.000	AT&T 4,5% 15/5/2035	494.873	0,09
USD 132.062	Alternative Loan Trust 2007-9T1 6% 25/5/2037	68.127	0,01	USD 78.000	AT&T 5,4% 15/2/2034	75.700	0,01
EUR 343.000	Altria 3,125% 15/6/2031	320.938	0,06	USD 110.000	Atmos Energy 3,375% 15/9/2049	78.929	0,01
				USD 288.000	Baltimore Gas and Electric 2,9% 15/6/2050	185.860	0,03
				USD 337.000	Baltimore Gas and Electric 3,75% 15/8/2047	256.215	0,05
				USD 250.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3,716% 14/4/2033	213.909	0,04
				USD 900.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,758% 15/11/2033	827.915	0,15

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 100.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6,858% 15/11/2032	83.958	0,02	USD 171.636	Bayview Commercial Asset Trust 2008-2 7,929% 25/4/2038	167.514	0,03
USD 300.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 7,358% 15/11/2032	247.228	0,04	USD 531.697	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 6,435% 28/5/2039	428.808	0,08
USD 100.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 6,708% 15/9/2034	99.311	0,02	USD 60.696	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 6,735% 28/5/2039	51.682	0,01
USD 410.000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 7,058% 15/9/2034	406.202	0,07	USD 22.616	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E 6,435% 28/12/2040	21.112	0,00
USD 62.000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2015-UBS7 4,482% 15/9/2048	55.687	0,01	USD 100.000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6,479% 15/3/2037	84.618	0,02
USD 510.000	BANK 2017-BNK9 3,538% 15/11/2054	469.043	0,09	USD 97.033	BBCMS Trust 2015-SRCH 3,312% 10/8/2035	88.744	0,02
USD 628.000	Bank of America 2,087% 14/6/2029	535.413	0,10	USD 128.157	BCAP Trust 2007-AA4 4,244% 25/6/2047	58.499	0,01
USD 1.201.000	Bank of America 2,972% 4/2/2033	987.909	0,18	USD 118.927	BCMSC Trust 2000-A 7,575% 15/6/2030	15.323	0,00
USD 596.000	Bank of America 4,571% 27/4/2033	552.730	0,10	USD 110.398	BCMSC Trust 2000-A 7,83% 15/6/2030	14.705	0,00
USD 1.206.000	Bank of America 5,202% 25/4/2029	1.187.808	0,22	USD 79.834	BCMSC Trust 2000-A 8,29% 15/6/2030	11.260	0,00
USD 369.000	Bank of America 5,288% 25/4/2034	360.433	0,07	USD 370.000	BDS 2022-FL12 7,45% 19/8/2038	369.464	0,07
USD 1.000.000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 0,735% 15/2/2050	18.176	0,00	USD 29.608	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 5,749% 25/11/2036	24.161	0,00
USD 1.000.000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 1,391% 15/2/2050	36.776	0,01	USD 155.178	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 5,749% 25/1/2047	127.300	0,02
USD 600.000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7,324% 10/12/2025	113.747	0,02	USD 80.202	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-AC9 6,25% 25/12/2035	50.819	0,01
USD 484.000	BAT Capital 3,984% 25/9/2050	320.282	0,06	USD 102.164	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-AC1 6,25% 25/2/2036	74.451	0,01
USD 168.000	BAT Capital 4,54% 15/8/2047	122.214	0,02	USD 78.414	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE1 5,02% 25/12/2035	115.620	0,02
USD 187.000	BAT Capital 4,758% 6/9/2049	138.362	0,03	USD 59.501	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE7 5,769% 25/9/2036	58.500	0,01
USD 195.000	BAT Capital 7,081% 2/8/2053	192.793	0,04	USD 8.612	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-FS1 5,769% 25/5/2035	8.493	0,00
USD 100.000	Bay Area Toll Authority 7,043% 1/4/2050	123.685	0,02	USD 40.301	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 5,569% 25/3/2037	36.444	0,01
USD 70.895	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 5,749% 25/11/2035	64.399	0,01	USD 31.752	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 5,679% 25/4/2037	45.411	0,01
USD 141.006	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 5,879% 25/1/2036	129.439	0,02	USD 461.571	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 5,779% 25/4/2037	464.696	0,08
USD 6.651	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 6,104% 25/1/2036	6.097	0,00	USD 13.609	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 5,769% 25/3/2037	12.458	0,00
USD 25.269	Bayview Commercial Asset Trust 2006-2 5,849% 25/7/2036	22.938	0,00	USD 25.121	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 5,569% 25/3/2037	21.444	0,00
USD 10.241	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5,679% 25/10/2036	9.465	0,00	USD 100.000	BHMS 2018-ATLS 6,857% 15/7/2035	98.287	0,02
USD 308.095	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 5,774% 25/12/2036	284.659	0,05	USD 360.000	BHMS 2018-ATLS 7,507% 15/7/2035	345.984	0,06
USD 164.553	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 5,834% 25/3/2037	148.082	0,03	USD 102.000	Boeing 3,825% 1/3/2059	70.670	0,01
USD 617.355	Bayview Commercial Asset Trust 2007-2 5,699% 25/7/2037	547.890	0,10	USD 260.000	Boeing 3,95% 1/8/2059	187.208	0,04
USD 483.105	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 6,929% 25/12/2037	410.603	0,07	USD 108.000	Boeing 5,93% 1/5/2060	104.574	0,02
				USD 333.000	Booz Allen Hamilton 5,95% 4/8/2033	336.663	0,06
				USD 358.000	Broadcom 3,137% 15/11/2035	273.295	0,05
				USD 1.297.000	Broadcom 3,469% 15/4/2034	1.060.327	0,19

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 494.000	Broadcom 4,15% 15/4/2032	442.597	0,08	USD 116.000	Charter Communications Operating / Charter		
USD 4.000	Buckeye Partners 3,95% 1/12/2026	3.685	0,00		Communications Operating Capital 3,7% 1/4/2051	72.188	0,01
USD 313.000	Burlington Northern Santa Fe 2,875% 15/6/2052	207.311	0,04	USD 302.000	Charter Communications Operating / Charter		
USD 138.000	Burlington Northern Santa Fe 3,05% 15/2/2051	94.644	0,02		Communications Operating Capital 3,85% 1/4/2061	180.782	0,03
USD 103.000	Burlington Northern Santa Fe 3,3% 15/9/2051	74.254	0,01	USD 771.000	Charter Communications Operating / Charter		
USD 109.000	Burlington Northern Santa Fe 4,9% 1/4/2044	102.725	0,02		Communications Operating Capital 3,9% 1/6/2052	494.020	0,09
USD 290.000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,446% 10/3/2033	263.705	0,05	USD 99.000	Charter Communications Operating / Charter		
USD 521.933	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3,454% 10/3/2033	490.054	0,09		Communications Operating Capital 3,95% 30/6/2062	59.839	0,01
USD 500.000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 4,058% 10/3/2033	423.941	0,08	USD 374.000	Charter Communications Operating / Charter		
USD 30.000	BXP Trust 2017-CC 3,67% 13/8/2037	22.095	0,00		Communications Operating Capital 4,8% 1/3/2050	277.396	0,05
USD 60.000	BXP Trust 2017-CC 3,67% 13/8/2037	41.561	0,01	USD 13.000	Charter Communications Operating / Charter		
USD 30.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	25.080	0,00		Communications Operating Capital 5,375% 1/5/2047	10.401	0,00
USD 50.000	BXP Trust 2017-GM 3,539% 13/6/2039	38.299	0,01	USD 94.000	Charter Communications Operating / Charter		
USD 9.000	Caesars Entertainment 4,625% 15/10/2029	7.896	0,00		Communications Operating Capital 6,834% 23/10/2055	87.382	0,02
USD 1.218.000	Cameron LNG 3,402% 15/1/2038	999.590	0,18	USD 760.993	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 6% 25/12/2037	334.379	0,06
USD 294.000	Capital One Financial 5,817% 1/2/2034	279.539	0,05	USD 335.000	Cheniere Corpus Christi 2,742% 31/12/2039	259.601	0,05
USD 85.017	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC3 5,579% 25/8/2036	79.885	0,01	USD 189.000	Cheniere Corpus Christi 3,7% 15/11/2029	171.678	0,03
USD 239.498	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 5,689% 25/2/2037	222.437	0,04	USD 1.377.000	Cheniere Corpus Christi 5,125% 30/6/2027	1.361.355	0,24
USD 37.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/3/2030	31.938	0,01	USD 229.000	Cheniere Corpus Christi 5,875% 31/3/2025	228.223	0,04
USD 32.000	CCO / CCO Capital 5,375% 1/6/2029	29.251	0,01	USD 1.314.000	Cheniere Energy Partners 3,25% 31/1/2032	1.085.394	0,20
USD 40.000	CD 2017-CD3 Mortgage Trust 3,631% 10/2/2050	35.627	0,01	USD 764.000	Cheniere Energy Partners 4% 1/3/2031	675.122	0,12
USD 100.000	CD 2017-CD5 Mortgage Trust 3,956% 15/8/2050	83.949	0,02	USD 882.000	Cheniere Energy Partners 4,5% 1/10/2029	814.171	0,15
USD 66.000	CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3,911% 13/11/2050	53.394	0,01	USD 5.740	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-29 5,969% 25/2/2035	5.092	0,00
USD 19.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,5% 1/5/2025	18.875	0,00	USD 1.220.953	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA4 5,39% 25/4/2046	382.413	0,07
USD 205.000	CenterPoint Energy Houston Electric 2,9% 1/7/2050	134.362	0,03	USD 16.244	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA5 5,829% 25/4/2046	15.111	0,00
USD 221.000	CenterPoint Energy Houston Electric 3,35% 1/4/2051	158.971	0,03	USD 343.277	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 6,5% 25/9/2037	132.010	0,02
USD 37.000	CenterPoint Energy Houston Electric 3,95% 1/3/2048	29.802	0,00	USD 16.000	Churchill Downs 4,75% 15/1/2028	14.789	0,00
USD 56.000	CenterPoint Energy Houston Electric 5,3% 1/4/2053	55.771	0,01	USD 31.000	Churchill Downs 5,5% 1/4/2027	29.891	0,01
USD 128.000	CenterPoint Energy Resources 5,25% 1/3/2028	127.724	0,02	USD 134.355	Citicorp Mortgage Trust Series 2008-2 6,5% 25/6/2038	104.567	0,02
USD 330.000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0,851% 10/5/2058	5.477	0,00	USD 631.000	Citigroup 3,057% 25/1/2033	520.789	0,09
USD 3.000	Charles River Laboratories International 4,25% 1/5/2028	2.753	0,00	USD 730.000	Citigroup 6,27% 17/11/2033	760.995	0,14
USD 180.000	Charles Schwab 5,853% 19/5/2034	180.188	0,03	USD 100.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 3,635% 10/5/2035	89.313	0,02
USD 165.000	Charles Schwab 6,136% 24/8/2034	168.113	0,03	USD 250.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 3,772% 10/2/2048	232.909	0,04
				USD 206.544	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 5,629% 25/5/2037	133.728	0,02

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 93.920	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 5,699% 25/5/2037	60.810	0,01	USD 21.200	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 3,053% 25/12/2036	16.998	0,00
USD 375.511	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL3 5,599% 25/7/2045	253.336	0,05	USD 196.589	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6,056% 25/9/2036	10.683	0,00
USD 23.460	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A6 6% 25/6/2037	20.378	0,00	USD 550.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 7,375% 1/2/2031	565.705	0,10
USD 100.000	City of San Antonio Electric & Gas Systems Revenue 5,808% 1/2/2041	105.907	0,02	USD 766.000	Crown Castle 2,1% 1/4/2031	604.472	0,11
USD 254.000	Civitas Resources 8,375% 1/7/2028	261.113	0,05	USD 842.000	Crown Castle 3,1% 15/11/2029	732.580	0,13
USD 32.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	28.730	0,01	USD 264.000	Crown Castle 3,3% 1/7/2030	229.478	0,04
USD 60.000	CNH Industrial Capital 4,2% 15/1/2024	59.599	0,01	USD 531.000	Crown Castle 5,1% 1/5/2033*	511.000	0,09
USD 468.000	Comcast 2,937% 1/11/2056	291.696	0,05	USD 14.000	CrownRock / CrownRock Finance 5,625% 15/10/2025	13.768	0,00
USD 124.000	Comcast 4,4% 15/8/2035	114.995	0,02	USD 800.000	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust 4,463% 15/11/2048	738.860	0,13
USD 47.000	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust 3,961% 10/3/2047	46.567	0,01	USD 1.910.000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 0,259% 15/11/2050	19.506	0,00
USD 10.000.000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust 0,168% 10/2/2035	11.599	0,00	USD 30.000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4,864% 15/8/2051	23.897	0,00
USD 1.224.080	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 0,942% 10/8/2048	14.990	0,00	USD 51.794	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-10 6,25% 25/11/2035	12.174	0,00
USD 72.000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 4,667% 10/8/2048	64.930	0,01	USD 100.000	CSMC 2017-TIME 3,646% 13/11/2039	85.389	0,02
USD 100.000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3,829% 10/2/2048	91.137	0,02	USD 1.468.642	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-6 6% 25/7/2036	747.083	0,14
USD 25.000	Commercial Metals 4,375% 15/3/2032	21.427	0,00	USD 80.409	CSMC Mortgage-Backed Trust 2007-5 7% 25/8/2037	49.838	0,01
USD 271.000	Commonwealth Edison 2,75% 1/9/2051	167.152	0,03	USD 31.151	CSMC Series 2014-4R 4,498% 27/2/2036	29.702	0,01
USD 217.000	Commonwealth Edison 3,125% 15/3/2051	146.754	0,03	USD 100.000	CSMC Trust 2017-CALI 3,904% 10/11/2032	47.184	0,01
USD 205.000	Commonwealth Edison 3,2% 15/11/2049	141.211	0,03	USD 122.000	CSX 2,5% 15/5/2051	74.303	0,01
USD 220.000	Connecticut Light and Power 4,9% 1/7/2033	216.863	0,04	USD 165.000	CSX 3,35% 15/9/2049	117.419	0,02
USD 51.683	Conseco Finance 7,5% 1/3/2030	19.660	0,00	USD 215.015	CWABS Asset-backed Certificates Series 2007-12 6,269% 25/8/2047	202.015	0,04
USD 37.813	Conseco Finance 7,53% 15/3/2028	36.734	0,01	USD 9.952	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-5 6,329% 25/10/2034	9.675	0,00
USD 48.540	Conseco Finance 7,86% 1/3/2030	19.222	0,00	USD 75.938	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 5,689% 25/12/2036	68.444	0,01
USD 108.833	Conseco Finance Securitizations 8,31% 1/5/2032	21.218	0,00	USD 640	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 5,749% 25/9/2046	636	0,00
USD 237.000	Consolidated Edison of New York 6,15% 15/11/2052	254.526	0,05	USD 497.606	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-18 5,879% 25/3/2037	394.520	0,07
USD 484.000	Consumers Energy 3,75% 15/2/2050	375.924	0,07	USD 88.408	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-22 5,659% 25/5/2047	70.567	0,01
USD 68.000	Consumers Energy 4,2% 1/9/2052	56.126	0,01	USD 3.198	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S3 5,631% 25/1/2029	4.632	0,00
USD 247.000	Consumers Energy 4,625% 15/5/2033	239.526	0,04	USD 3.972	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 6,155% 25/6/2035	4.758	0,00
USD 408	Countrywide Asset-Backed Certificates 5,649% 25/12/2025	967	0,00	USD 9.435	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 5,615% 15/5/2035	9.408	0,00
USD 317.342	Countrywide Asset-Backed Certificates 5,929% 25/1/2046	295.072	0,05				
USD 1.641.941	Credit Suisse First Boston Mortgage 6,5% 25/1/2036	1.018.427	0,18				
USD 585.360	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 6,5% 27/10/2037	238.055	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.154	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 5,615% 15/5/2035	2.129	0,00	USD 100.000	Eastman Chemical 5,75% 8/3/2033	98.690	0,02
USD 4.997	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 5,725% 15/12/2033	4.991	0,00	USD 130.000	Edison International 4,125% 15/3/2028	121.576	0,02
USD 17.085	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H 5,575% 15/11/2036	16.728	0,00	USD 454.000	Edison International 5,25% 15/11/2028	443.277	0,08
USD 33.884	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I 5,565% 15/1/2037	31.051	0,01	USD 323.000	Edison International 5,75% 15/6/2027	323.441	0,06
USD 900.000	DBGS 2018-5BP Mortgage Trust 6,388% 15/6/2033	807.995	0,15	USD 297.000	Edison International 6,95% 15/11/2029	312.748	0,06
USD 219.303	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7,606% 15/5/2035	213.749	0,04	USD 133.000	Elevance Health 3,125% 15/5/2050	90.232	0,02
USD 70.000	DBJPM 16-C1 Mortgage Trust 3,276% 10/5/2049	65.372	0,01	USD 191.000	Elevance Health 4,55% 15/5/2052	164.644	0,03
USD 450.000	DBJPM 2017-C6 Mortgage Trust 3,561% 10/6/2050	389.697	0,07	USD 103.000	Energy Transfer 4,9% 15/3/2035	94.119	0,02
USD 290.000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	226.686	0,04	USD 1.012.000	Energy Transfer 5% 15/5/2050	834.502	0,15
USD 100.000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3,648% 10/10/2034	77.664	0,01	USD 136.000	Energy Transfer 5,15% 1/2/2043	114.595	0,02
USD 341.000	Dell International / EMC 4,9% 1/10/2026	334.671	0,06	USD 736.000	Energy Transfer 5,3% 15/4/2047	624.964	0,11
USD 218.000	Dell International / EMC 5,25% 1/2/2028	217.289	0,04	USD 130.000	Energy Transfer 5,4% 1/10/2047	112.332	0,02
USD 479.000	Delta Air Lines 2019-1 Class AA Pass Through Trust 3,204% 25/4/2024	470.300	0,09	USD 155.000	Energy Transfer 6,5% 1/2/2042	154.629	0,03
USD 929.915	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2006-AR5 5,689% 25/10/2036	293.625	0,05	USD 133.000	Entergy Louisiana 4,2% 1/9/2048	106.912	0,02
USD 448.969	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4 5,769% 25/8/2047	396.118	0,07	USD 246.000	EQT 3,125% 15/5/2026	228.772	0,04
USD 125.000	Devon Energy 4,75% 15/5/2042	104.268	0,02	USD 301.000	EQT 3,625% 15/5/2031	259.406	0,05
USD 1.609.000	Diamondback Energy 3,125% 24/3/2031	1.384.086	0,25	USD 339.000	EQT 3,9% 1/10/2027	316.595	0,06
USD 2.298.000	Diamondback Energy 3,25% 1/12/2026	2.159.538	0,39	USD 293.000	EQT 5% 15/1/2029	277.957	0,05
USD 2.419.000	Diamondback Energy 3,5% 1/12/2029	2.186.289	0,39	USD 108.000	EQT 5,7% 1/4/2028	107.539	0,02
USD 534.000	DTE Electric 3,95% 1/3/2049	425.427	0,08	USD 630.000	EQT 7% 1/2/2030	659.582	0,12
USD 425.000	Duke Energy Carolinas 3,2% 15/8/2049	292.392	0,05	USD 243.000	Equinix 2,15% 15/7/2030	196.311	0,04
USD 124.000	Duke Energy Carolinas 3,45% 15/4/2051	87.774	0,02	USD 245.000	Eversource Energy 5,45% 1/3/2028	245.630	0,04
USD 530.000	Duke Energy Carolinas 3,875% 15/3/2046	407.454	0,07	USD 112.000	Exelon 5,6% 15/3/2053	108.462	0,02
USD 281.000	Duke Energy Florida 1,75% 15/6/2030	227.165	0,04	USD 110.000	Extra Space Storage 5,5% 1/7/2030	109.065	0,02
USD 761.000	Duke Energy Florida 3% 15/12/2051	499.202	0,09	USD 522.000	FactSet Research Systems 3,45% 1/3/2032	442.762	0,08
USD 95.000	Duke Energy Florida 5,95% 15/11/2052	99.435	0,02	USD 1.245.845	Fannie Mae Interest Strip 3% 25/3/2050	213.655	0,04
USD 216.000	Duke Energy Progress 2,5% 15/8/2050	127.922	0,02	USD 367.785	Fannie Mae Interest Strip 3,5% 25/8/2049	65.661	0,01
USD 528.000	Duke Energy Progress 3,45% 15/3/2029	485.150	0,09	USD 58.490	Fannie Mae Pool 1,5% 1/3/2036	50.414	0,01
USD 111.000	Duke Energy Progress 3,7% 15/10/2046	83.163	0,01	USD 93.129	Fannie Mae Pool 1,5% 1/5/2036	80.256	0,01
USD 140.000	Duke Energy Progress 4% 1/4/2052	109.855	0,02	USD 333.260	Fannie Mae Pool 1,5% 1/6/2036	286.603	0,05
USD 132.000	Duke Energy Progress 5,35% 15/3/2053	128.285	0,02	USD 152.162	Fannie Mae Pool 1,5% 1/12/2036	130.804	0,02
				USD 97.025	Fannie Mae Pool 1,5% 1/2/2037	83.628	0,02
				USD 3.823.932	Fannie Mae Pool 1,5% 1/11/2041	3.075.351	0,56
				USD 1.941.121	Fannie Mae Pool 1,5% 1/12/2041	1.561.148	0,28
				USD 424.916	Fannie Mae Pool 1,5% 1/10/2050	322.379	0,06
				USD 369.113	Fannie Mae Pool 1,5% 1/11/2050	279.379	0,05
				USD 495.163	Fannie Mae Pool 1,5% 1/3/2051	374.865	0,07
				USD 11.790	Fannie Mae Pool 2% 1/10/2031	10.587	0,00
				USD 59.495	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2031	53.423	0,01
				USD 3.622	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2031	3.252	0,00
				USD 19.445	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2031	17.401	0,00
				USD 69.303	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2031	62.234	0,01
				USD 16.317	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2031	14.651	0,00
				USD 107.802	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2032	96.801	0,02
				USD 45.920	Fannie Mae Pool 2% 1/6/2035	40.634	0,01
				USD 96.064	Fannie Mae Pool 2% 1/6/2035	85.009	0,02
				USD 48.292	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2035	42.664	0,01
				USD 55.167	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2036	48.741	0,01
				USD 84.812	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2036	74.733	0,01
				USD 119.964	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2036	106.158	0,02
				USD 79.470	Fannie Mae Pool 2% 1/5/2036	70.298	0,01
				USD 134.008	Fannie Mae Pool 2% 1/7/2036	118.384	0,02
				USD 126.203	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2036	111.639	0,02
				USD 141.109	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2036	124.787	0,02
				USD 59.862	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2036	52.935	0,01
				USD 58.846	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2037	52.036	0,01

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 126.350	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2037	111.242	0,02	USD 3.408	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2030	3.175	0,00
USD 25.193	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2037	22.189	0,00	USD 10.813	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2030	10.254	0,00
USD 57.895	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2037	51.016	0,01	USD 25.150	Fannie Mae Pool 2,5% 1/3/2030	23.394	0,00
USD 214.695	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2037	188.887	0,03	USD 19.787	Fannie Mae Pool 2,5% 1/4/2030	18.371	0,00
USD 68.978	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2037	60.754	0,01	USD 10.504	Fannie Mae Pool 2,5% 1/5/2030	9.756	0,00
USD 303.293	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2037	267.256	0,05	USD 23.401	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2030	21.769	0,00
USD 180.387	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2037	158.925	0,03	USD 4.388	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2030	4.081	0,00
USD 244.926	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2040	207.098	0,04	USD 12.174	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2030	11.290	0,00
USD 204.282	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2041	169.269	0,03	USD 19.391	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2030	18.043	0,00
USD 136.746	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2042	113.781	0,02	USD 41.402	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2030	38.526	0,01
USD 1.353.895	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2042	1.126.247	0,20	USD 24.722	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2030	22.998	0,00
USD 208.802	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2042	173.750	0,03	USD 31.603	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2030	29.779	0,01
USD 592.562	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2042	493.432	0,09	USD 30.779	Fannie Mae Pool 2,5% 1/9/2030	28.635	0,01
USD 95.132	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2050	76.376	0,01	USD 38.830	Fannie Mae Pool 2,5% 1/9/2030	36.120	0,01
USD 184.355	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2050	147.917	0,03	USD 2.347	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2030	2.183	0,00
USD 331.562	Fannie Mae Pool 2% 1/10/2050	266.345	0,05	USD 33.702	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2030	31.348	0,01
USD 76.704	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2050	61.436	0,01	USD 28.473	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2030	26.485	0,01
USD 106.465	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2050	86.194	0,02	USD 37.904	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2030	35.264	0,01
USD 331.799	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2050	268.129	0,05	USD 30.776	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2030	28.627	0,01
USD 1.606.612	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	1.288.122	0,23	USD 16.777	Fannie Mae Pool 2,5% 1/3/2031	15.964	0,00
USD 246.017	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2051	197.079	0,04	USD 39.033	Fannie Mae Pool 2,5% 1/6/2031	35.978	0,01
USD 217.219	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2051	175.534	0,03	USD 27.942	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2031	25.751	0,00
USD 122.299	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2051	99.006	0,02	USD 3.892	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2031	3.580	0,00
USD 136.107	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	110.375	0,02	USD 20.534	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2031	18.925	0,00
USD 189.102	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	152.815	0,03	USD 45.410	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2031	41.845	0,01
USD 184.754	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	149.563	0,03	USD 22.906	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2031	21.112	0,00
USD 70.479	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	57.052	0,01	USD 73.644	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2031	67.864	0,01
USD 559.435	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2051	446.530	0,08	USD 38.193	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2031	35.197	0,01
USD 923.661	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2051	738.392	0,13	USD 8.399	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2031	7.740	0,00
USD 586.263	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2051	471.366	0,09	USD 4.421	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2031	4.074	0,00
USD 374.933	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	303.249	0,06	USD 6.599	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2031	6.081	0,00
USD 565.278	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	452.276	0,08	USD 1.494	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2031	1.377	0,00
USD 108.934	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	88.397	0,02	USD 3.616	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2031	3.333	0,00
USD 113.523	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	92.002	0,02	USD 6.822	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2032	6.286	0,00
USD 198.319	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	160.463	0,03	USD 28.187	Fannie Mae Pool 2,5% 1/3/2032	25.973	0,01
USD 375.749	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	300.220	0,05	USD 158.514	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2032	146.092	0,03
USD 2.135.005	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	1.705.522	0,31	USD 276.098	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2033	256.837	0,05
USD 169.162	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	136.667	0,02	USD 248.509	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2035	225.417	0,04
USD 261.302	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	210.938	0,04				
USD 391.382	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	314.305	0,06				
USD 391.874	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	315.783	0,06				
USD 72.222	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	59.293	0,01				
USD 79.734	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	63.687	0,01				
USD 356.069	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	288.074	0,05				
USD 274.297	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	221.609	0,04				
USD 306.677	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	247.764	0,05				
USD 449.133	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	367.046	0,07				
USD 84.212	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	67.428	0,01				
USD 179.664	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	145.343	0,03				
USD 415.393	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	335.590	0,06				
USD 926.618	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	746.282	0,14				
USD 214.843	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	173.572	0,03				
USD 343.495	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	274.632	0,05				
USD 191.864	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	154.680	0,03				
USD 350.793	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	282.454	0,05				
USD 134.360	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	108.453	0,02				
USD 9.629	Fannie Mae Pool 2,5% 1/9/2027	9.198	0,00				
USD 14.596	Fannie Mae Pool 2,5% 1/9/2027	13.950	0,00				
USD 4.243	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2028	4.038	0,00				
USD 8.702	Fannie Mae Pool 2,5% 1/4/2028	8.281	0,00				
USD 27.114	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2028	25.727	0,00				
USD 2.918	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2030	2.719	0,00				

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 245.448	Fannie Mae Pool 2,5% 1/10/2035	222.112	0,04	USD 40.529	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2030	38.254	0,01
USD 532.881	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2035	481.172	0,09	USD 33.068	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2030	31.217	0,01
USD 703.752	Fannie Mae Pool 2,5% 1/12/2035	635.689	0,12	USD 17.267	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2030	16.301	0,00
USD 802.941	Fannie Mae Pool 2,5% 1/12/2035	725.051	0,13	USD 27.269	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	25.735	0,00
USD 269.913	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2050	229.214	0,04	USD 7.208	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	6.803	0,00
USD 462.673	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2050	389.546	0,07	USD 35.331	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	33.353	0,01
USD 455.024	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2050	383.120	0,07	USD 5.212	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	4.907	0,00
USD 466.111	Fannie Mae Pool 2,5% 1/7/2050	392.471	0,07	USD 49.931	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	47.120	0,01
USD 534.889	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2050	450.344	0,08	USD 41.700	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	39.366	0,01
USD 439.808	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2050	370.292	0,07	USD 31.058	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	29.319	0,01
USD 137.245	Fannie Mae Pool 2,5% 1/8/2050	115.549	0,02	USD 37.848	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	35.729	0,01
USD 309.754	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2050	262.977	0,05	USD 7.399	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	6.984	0,00
USD 82.770	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2050	70.272	0,01	USD 6.815	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	6.433	0,00
USD 75.709	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2051	63.699	0,01	USD 2.626	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	2.469	0,00
USD 739.803	Fannie Mae Pool 2,5% 1/9/2051	620.423	0,11	USD 29.596	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	27.934	0,01
USD 226.868	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2051	191.714	0,03	USD 34.567	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	32.630	0,01
USD 4.306.672	Fannie Mae Pool 2,5% 1/11/2051	3.605.844	0,65	USD 14.650	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	13.813	0,00
USD 482.155	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	405.945	0,07	USD 20.567	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	19.284	0,00
USD 585.261	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	492.799	0,09	USD 182.909	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	172.115	0,03
USD 878.677	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	736.145	0,13	USD 43.700	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2031	41.252	0,01
USD 272.919	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	229.544	0,04	USD 72.586	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2032	68.514	0,01
USD 236.884	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	197.879	0,04	USD 167.509	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2035	155.216	0,03
USD 449.089	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	375.795	0,07	USD 157.934	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2035	146.392	0,03
USD 585.859	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	491.518	0,09	USD 221.831	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2035	205.658	0,04
USD 729.982	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	611.210	0,11	USD 104.899	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2035	97.192	0,02
USD 662.836	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	558.149	0,10	USD 16.618	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2036	15.440	0,00
USD 737.669	Fannie Mae Pool 2,5% 1/1/2052	619.417	0,11	USD 33.607	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2036	31.134	0,01
USD 134.338	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	113.503	0,02	USD 24.870	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2036	23.018	0,00
USD 477.636	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	401.949	0,07	USD 43.173	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2036	40.201	0,01
USD 565.668	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	474.385	0,09	USD 5.512	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2036	5.064	0,00
USD 91.548	Fannie Mae Pool 2,5% 1/2/2052	77.543	0,01	USD 44.139	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2036	40.555	0,01
USD 9.871	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2028	9.458	0,00	USD 18.411	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2036	16.916	0,00
USD 11.755	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2028	11.257	0,00	USD 56.620	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2036	51.876	0,01
USD 25.764	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2028	24.661	0,00	USD 43.292	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2036	39.809	0,01
USD 26.034	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2029	24.523	0,00	USD 152.087	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2043	134.765	0,02
USD 30.701	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2029	28.868	0,01	USD 319.874	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2043	283.346	0,05
USD 44.459	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2029	41.965	0,01	USD 6.994	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2046	6.162	0,00
USD 26.982	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2029	25.474	0,00	USD 36.097	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2046	31.826	0,01
USD 39.005	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2029	36.817	0,01	USD 6.354	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2046	5.585	0,00
USD 184.258	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2030	173.922	0,03	USD 217.358	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2046	191.079	0,03
				USD 128.442	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2047	112.943	0,02
				USD 676.159	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2050	589.978	0,11
				USD 460.353	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2051	399.014	0,07
				USD 203.992	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2051	177.636	0,03
				USD 668.617	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2052	581.516	0,11
				USD 53.934	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2052	47.017	0,01
				USD 85.052	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2052	73.655	0,01
				USD 32.783	Fannie Mae Pool 3,5% 1/3/2029	31.393	0,01
				USD 26.171	Fannie Mae Pool 3,5% 1/8/2030	25.057	0,00
				USD 24.007	Fannie Mae Pool 3,5% 1/11/2032	22.976	0,00
				USD 14.785	Fannie Mae Pool 3,5% 1/1/2033	14.149	0,00
				USD 41.770	Fannie Mae Pool 3,5% 1/1/2042	38.463	0,01
				USD 4.828	Fannie Mae Pool 3,5% 1/4/2042	4.446	0,00
				USD 13.755	Fannie Mae Pool 3,5% 1/4/2042	12.667	0,00
				USD 1.743	Fannie Mae Pool 3,5% 1/5/2042	1.605	0,00
				USD 2.663	Fannie Mae Pool 3,5% 1/6/2042	2.453	0,00
				USD 1.984	Fannie Mae Pool 3,5% 1/6/2042	1.827	0,00
				USD 5.989	Fannie Mae Pool 3,5% 1/7/2042	5.515	0,00
				USD 349.181	Fannie Mae Pool 3,5% 1/6/2044	321.860	0,06
				USD 48.682	Fannie Mae Pool 3,5% 1/2/2045	44.827	0,01
				USD 351.190	Fannie Mae Pool 3,5% 1/2/2045	323.416	0,06
				USD 15.404	Fannie Mae Pool 3,5% 1/11/2046	14.024	0,00
				USD 85.371	Fannie Mae Pool 3,5% 1/5/2047	77.753	0,01
				USD 82.158	Fannie Mae Pool 3,5% 1/11/2047	74.661	0,01
				USD 82.547	Fannie Mae Pool 3,5% 1/12/2047	75.011	0,01
				USD 49.763	Fannie Mae Pool 3,5% 1/1/2048	45.281	0,01

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 37.870	Fannie Mae Pool 3,5% 1/2/2048	34.416	0,01	USD 229.549	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2043	220.914	0,04
USD 73.691	Fannie Mae Pool 3,5% 1/4/2048	67.338	0,01	USD 205.807	Fannie Mae Pool 4,5% 1/6/2044	199.307	0,04
USD 535.836	Fannie Mae Pool 3,5% 1/8/2050	488.435	0,09	USD 308.220	Fannie Mae Pool 4,5% 1/12/2044	298.432	0,05
USD 103.545	Fannie Mae Pool 3,5% 1/8/2050	93.344	0,02	USD 88.720	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2045	85.904	0,02
USD 3.912.085	Fannie Mae Pool 3,5% 1/1/2051	3.554.052	0,64	USD 30.158	Fannie Mae Pool 4,5% 1/9/2045	29.205	0,01
USD 50.895	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2033	49.335	0,01	USD 130.933	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2045	126.803	0,02
USD 79.582	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2036	75.679	0,01	USD 21.045	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2045	20.377	0,00
USD 12.943	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2041	12.211	0,00	USD 2.374	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2045	2.296	0,00
USD 59.153	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2042	56.202	0,01	USD 48.628	Fannie Mae Pool 4,5% 1/12/2045	47.085	0,01
USD 19.949	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2042	18.954	0,00	USD 295.050	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2046	285.764	0,05
USD 86.739	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2042	82.415	0,02	USD 21.782	Fannie Mae Pool 4,5% 1/10/2047	20.926	0,00
USD 239.363	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2044	227.518	0,04	USD 77.994	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2047	75.405	0,01
USD 42.519	Fannie Mae Pool 4% 1/11/2046	40.007	0,01	USD 107.601	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2047	104.153	0,02
USD 139.267	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2047	131.491	0,02	USD 178.507	Fannie Mae Pool 4,5% 1/1/2048	172.628	0,03
USD 52.619	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2047	49.486	0,01	USD 76.972	Fannie Mae Pool 4,5% 1/4/2048	74.180	0,01
USD 10.730	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2047	10.073	0,00	USD 222.608	Fannie Mae Pool 4,5% 1/5/2048	216.846	0,04
USD 12.726	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2047	11.970	0,00	USD 727.983	Fannie Mae Pool 4,5% 1/5/2048	703.309	0,13
USD 49.317	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2047	46.508	0,01	USD 31.660	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2048	30.677	0,01
USD 61.748	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2048	58.074	0,01	USD 143.549	Fannie Mae Pool 4,5% 1/8/2048	138.793	0,03
USD 19.167	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2048	18.069	0,00	USD 112.367	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2048	108.481	0,02
USD 21.644	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2048	20.262	0,00	USD 960.788	Fannie Mae Pool 4,5% 1/2/2049	931.826	0,17
USD 15.948	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2048	14.995	0,00	USD 871.600	Fannie Mae Pool 4,5% 1/5/2049	845.311	0,15
USD 15.817	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2048	14.872	0,00	USD 68.170	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2052	64.696	0,01
USD 123.357	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2048	115.407	0,02	USD 147.041	Fannie Mae Pool 5% 1/2/2035	147.046	0,03
USD 93.515	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2048	87.983	0,02	USD 9.036	Fannie Mae Pool 5% 1/9/2035	9.037	0,00
USD 16.555	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2048	15.552	0,00	USD 127.201	Fannie Mae Pool 5% 1/7/2041	126.951	0,02
USD 33.622	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2048	31.455	0,01	USD 237.893	Fannie Mae Pool 5% 1/12/2043	237.621	0,04
USD 95.733	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2048	89.814	0,02	USD 14.663	Fannie Mae Pool 5% 1/8/2048	14.453	0,00
USD 46.596	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2048	43.673	0,01	USD 18.678	Fannie Mae Pool 5% 1/9/2048	18.384	0,00
USD 130.985	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2049	123.358	0,02	USD 36.199	Fannie Mae Pool 5% 1/9/2048	35.661	0,01
USD 415.659	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2049	388.931	0,07	USD 148.019	Fannie Mae Pool 5% 1/5/2049	145.938	0,03
USD 185.362	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2050	172.738	0,03	USD 54.688	Fannie Mae Pool 5% 1/1/2053	53.090	0,01
USD 15.367	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	14.388	0,00	USD 320.848	Fannie Mae Pool 5% 1/1/2053	311.366	0,06
USD 99.849	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	93.288	0,02	USD 411.728	Fannie Mae Pool 5% 1/4/2053	400.989	0,07
USD 171.918	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2050	160.606	0,03	USD 84.884	Fannie Mae Pool 5,5% 1/2/2035	86.279	0,02
USD 222.115	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2050	207.144	0,04	USD 152.204	Fannie Mae Pool 5,5% 1/9/2036	154.659	0,03
USD 202.152	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2050	189.621	0,03	USD 79.506	Fannie Mae Pool 5,5% 1/8/2037	80.814	0,01
USD 51.867	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2050	48.249	0,01	USD 92.636	Fannie Mae Pool 5,5% 1/9/2039	94.158	0,02
USD 22.807	Fannie Mae Pool 4% 1/11/2050	21.306	0,00	USD 7.582	Fannie Mae Pool 5,5% 1/4/2041	7.565	0,00
USD 859.996	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2051	803.811	0,15	USD 118.222	Fannie Mae Pool 5,5% 1/1/2053	116.920	0,02
USD 886.204	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2051	827.570	0,15	USD 92.006	Fannie Mae Pool 5,5% 1/1/2053	91.045	0,02
USD 2.289.973	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2051	2.146.829	0,39	USD 91.977	Fannie Mae Pool 5,5% 1/5/2053	90.988	0,02
USD 2.336.696	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2051	2.181.159	0,39	USD 96.059	Fannie Mae Pool 5,5% 1/5/2053	95.015	0,02
USD 34.630	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	32.244	0,01	USD 425.827	Fannie Mae Pool 5,5% 1/5/2053	421.328	0,08
USD 400.118	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	372.029	0,07	USD 366.667	Fannie Mae Pool 5,5% 1/5/2053	362.793	0,07
USD 209.840	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2052	196.982	0,04	USD 316.952	Fannie Mae Pool 5,5% 1/6/2053	313.549	0,06
USD 2.906	Fannie Mae Pool 4,5% 1/2/2025	2.849	0,00	USD 19.276	Fannie Mae Pool 6% 1/2/2038	19.886	0,00
USD 639	Fannie Mae Pool 4,5% 1/4/2025	627	0,00	USD 8.544	Fannie Mae Pool 6% 1/3/2038	8.820	0,00
USD 1.416	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2025	1.389	0,00	USD 24.050	Fannie Mae Pool 6% 1/5/2038	24.824	0,00
USD 7.857	Fannie Mae Pool 4,5% 1/6/2026	7.704	0,00	USD 6.451	Fannie Mae Pool 6% 1/10/2038	6.580	0,00
USD 16.259	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2040	15.850	0,00	USD 5.339	Fannie Mae Pool 6% 1/10/2038	5.512	0,00
USD 17.258	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2040	16.823	0,00				
USD 18.398	Fannie Mae Pool 4,5% 1/3/2041	17.931	0,00				
USD 6.908	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2041	6.733	0,00				
USD 26.436	Fannie Mae Pool 4,5% 1/9/2041	25.765	0,00				
USD 48.295	Fannie Mae Pool 4,5% 1/9/2042	47.087	0,01				
USD 32.000	Fannie Mae Pool 4,5% 1/9/2043	30.873	0,01				
USD 21.864	Fannie Mae Pool 4,5% 1/10/2043	21.091	0,00				

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 15.081	Fannie Mae Pool 6% 1/10/2038	15.568	0,00	USD 48.155	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/8/2030	44.868	0,01
USD 9.762	Fannie Mae Pool 6% 1/12/2038	10.078	0,00	USD 39.860	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/8/2030	37.141	0,01
USD 169.565	Fannie Mae Pool 6% 1/7/2039	171.613	0,03	USD 39.145	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/9/2030	36.472	0,01
USD 37.539	Fannie Mae Pool 6% 1/4/2040	38.746	0,01	USD 75.938	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/9/2030	70.758	0,01
USD 4.659	Fannie Mae Pool 6% 1/9/2040	4.802	0,00	USD 1.122	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/2/2031	1.042	0,00
USD 9.099	Fannie Mae Pool 6% 1/6/2041	9.392	0,00	USD 106.000	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/4/2031	98.759	0,02
USD 43.182	Fannie Mae Pool 6% 1/11/2052	43.389	0,01	USD 16.400	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/9/2027	15.755	0,00
USD 321.307	Fannie Mae Pool 6% 1/1/2053	322.224	0,06	USD 9.667	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/7/2028	9.274	0,00
USD 151.068	Fannie Mae Pool 6% 1/4/2053	151.809	0,03	USD 12.478	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/1/2030	11.795	0,00
USD 53.232	Fannie Mae Pool 6% 1/5/2053	53.487	0,01	USD 16.195	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/1/2030	15.306	0,00
USD 304.782	Fannie Mae Pool 6% 1/5/2053	306.277	0,06	USD 53.441	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/5/2030	50.507	0,01
USD 107.840	Fannie Mae Pool 6% 1/5/2053	108.371	0,02	USD 99.865	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/6/2030	94.398	0,02
USD 441.982	Fannie Mae Pool 6% 1/7/2053	444.158	0,08	USD 50.389	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/7/2030	47.541	0,01
USD 1.096.934	Fannie Mae Pool 6% 1/8/2053	1.099.589	0,20	USD 8.099	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/7/2030	7.654	0,00
USD 64.583	Fannie Mae Pool 6,5% 1/5/2040	66.928	0,01	USD 7.266	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/8/2030	6.867	0,00
USD 315.127	Fannie Mae REMICS 3,5% 25/2/2051	56.573	0,01	USD 11.583	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/8/2030	10.949	0,00
USD 358.139	Fannie Mae REMICS 4% 25/6/2051	71.340	0,01	USD 10.508	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/10/2032	9.908	0,00
USD 220.062	FBR Securitization Trust 6,134% 25/11/2035	213.853	0,04	USD 14.401	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/11/2032	13.606	0,00
USD 41.847	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 6,479% 25/10/2034	38.187	0,01	USD 10.542	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/12/2032	9.961	0,00
USD 82.018	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5,669% 25/10/2036	54.797	0,01	USD 26.383	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/1/2043	23.404	0,00
USD 48.054	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5,749% 25/10/2036	31.130	0,01	USD 53.208	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/3/2043	47.198	0,01
USD 473.746	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF16 5,709% 25/12/2036	199.368	0,04	USD 15.742	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/3/2043	13.962	0,00
USD 188.455	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF17 5,579% 25/12/2036	167.708	0,03	USD 171.334	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/8/2043	152.004	0,03
USD 122.902	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FFH1 6,029% 25/1/2036	106.030	0,02	USD 242.361	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/12/2046	213.405	0,04
USD 312.095	First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-FF2 5,709% 25/3/2037	168.640	0,03	USD 56.664	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/12/2046	49.756	0,01
USD 61.000	FirstEnergy 2,05% 1/3/2025	57.354	0,01	USD 29.789	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/12/2046	26.233	0,01
USD 303.000	FirstEnergy 3,4% 1/3/2050	200.140	0,04	USD 31.455	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/12/2046	27.685	0,01
USD 68.000	FirstEnergy 4,15% 15/7/2027	63.949	0,01	USD 14.809	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/12/2046	13.102	0,00
USD 381.000	FirstEnergy Transmission 4,55% 1/4/2049	309.565	0,06	USD 9.864	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/2/2031	9.460	0,00
USD 268.251	Flagstar Mortgage Trust 2018-6RR 4,921% 25/10/2048	229.512	0,04	USD 85.183	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/4/2031	81.670	0,02
USD 274.000	Florida Power & Light 3,15% 1/10/2049	191.785	0,04	USD 3.664	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/4/2031	3.503	0,00
USD 8.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032	6.257	0,00	USD 232.818	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/4/2032	222.971	0,04
USD 30.232	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/1/2029	28.760	0,01	USD 43.367	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/4/2042	39.984	0,01
USD 25.793	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/3/2030	24.036	0,00	USD 4.222	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/5/2042	3.893	0,00
USD 27.879	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/5/2030	25.896	0,00	USD 1.475	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/5/2042	1.360	0,00
USD 45.050	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/5/2030	41.975	0,01				
USD 8.705	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/7/2030	8.111	0,00				
USD 10.309	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/7/2030	9.574	0,00				
USD 2.755	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/7/2030	2.566	0,00				
USD 3.358	Freddie Mac Gold Pool 2,5% 1/7/2030	3.129	0,00				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 24.278	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/8/2042	22.388	0,00	USD 163.410	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/8/2048	158.025	0,03
USD 13.709	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/8/2042	12.640	0,00	USD 90.564	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/4/2049	87.343	0,02
USD 5.346	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/10/2042	4.903	0,00	USD 12.423	Freddie Mac Gold Pool 5% 1/10/2041	12.434	0,00
USD 15.849	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/6/2043	14.604	0,00	USD 165.121	Freddie Mac Gold Pool 5% 1/11/2041	165.156	0,03
USD 21.207	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/6/2043	19.560	0,00	USD 31.555	Freddie Mac Gold Pool 5% 1/11/2048	31.177	0,01
USD 13.014	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/7/2043	12.004	0,00	USD 112.235	Freddie Mac Gold Pool 5,5% 1/7/2038	114.386	0,02
USD 11.153	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/1/2044	10.287	0,00	USD 64.508	Freddie Mac Gold Pool 5,5% 1/6/2041	65.850	0,01
USD 9.083	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/9/2044	8.378	0,00	USD 10	Freddie Mac Gold Pool 6% 1/1/2034	10	0,00
USD 10.524	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/9/2045	9.707	0,00	USD 41.618	Freddie Mac Gold Pool 6% 1/6/2035	41.801	0,01
USD 92.929	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/3/2047	85.169	0,02	USD 2.521.000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,024% 25/6/2029	111.195	0,02
USD 127.254	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/10/2047	117.716	0,02	USD 691.076	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,119% 25/10/2030	38.012	0,01
USD 145.773	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/12/2047	134.857	0,02	USD 320.000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1,467% 25/12/2029	18.541	0,00
USD 18.786	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/1/2048	17.377	0,00	USD 63.908	Freddie Mac Pool 1,5% 1/4/2036	55.088	0,01
USD 30.117	Freddie Mac Gold Pool 3,5% 1/1/2048	27.516	0,01	USD 451.777	Freddie Mac Pool 1,5% 1/4/2036	390.484	0,07
USD 10.928	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/8/2040	10.398	0,00	USD 85.382	Freddie Mac Pool 1,5% 1/5/2036	73.430	0,01
USD 118.939	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/9/2040	113.170	0,02	USD 163.067	Freddie Mac Pool 1,5% 1/8/2050	123.715	0,02
USD 18.799	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/9/2040	17.883	0,00	USD 407.030	Freddie Mac Pool 1,5% 1/10/2050	308.525	0,06
USD 762	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/4/2041	725	0,00	USD 143.609	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2035	126.901	0,02
USD 17.550	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/4/2044	16.700	0,00	USD 309.043	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2036	273.469	0,05
USD 18.698	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/7/2044	17.697	0,00	USD 222.828	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2036	196.855	0,04
USD 63.339	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/9/2045	60.183	0,01	USD 156.624	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2036	138.716	0,03
USD 13.206	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/12/2045	12.545	0,00	USD 55.938	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2036	49.296	0,01
USD 11.798	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/12/2045	11.150	0,00	USD 342.591	Freddie Mac Pool 2% 1/5/2036	303.027	0,06
USD 25.460	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/2/2039	24.850	0,00	USD 351.000	Freddie Mac Pool 2% 1/6/2036	310.465	0,06
USD 11.596	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/12/2039	11.315	0,00	USD 149.821	Freddie Mac Pool 2% 1/7/2036	132.519	0,02
USD 25.413	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/5/2041	24.737	0,00	USD 106.359	Freddie Mac Pool 2% 1/4/2037	93.811	0,02
USD 29.988	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/5/2041	29.262	0,01	USD 83.724	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2042	69.663	0,01
USD 9.847	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/11/2043	9.548	0,00	USD 272.699	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2042	226.845	0,04
USD 70.271	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/12/2043	68.585	0,01	USD 87.772	Freddie Mac Pool 2% 1/4/2042	72.892	0,01
USD 149.836	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/4/2047	145.284	0,03	USD 67.012	Freddie Mac Pool 2% 1/8/2050	54.143	0,01
USD 57.971	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/5/2047	56.219	0,01	USD 125.538	Freddie Mac Pool 2% 1/11/2050	101.617	0,02
USD 115.853	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/7/2047	112.351	0,02	USD 4.084.508	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2051	3.272.307	0,59
USD 59.573	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/7/2047	57.763	0,01	USD 659.096	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2051	527.811	0,10
USD 494.599	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/7/2048	479.580	0,09	USD 299.849	Freddie Mac Pool 2% 1/4/2051	243.164	0,04
USD 734.171	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/8/2048	710.635	0,13	USD 226.164	Freddie Mac Pool 2% 1/5/2051	183.097	0,03
				USD 869.040	Freddie Mac Pool 2% 1/7/2051	708.840	0,13
				USD 49.900	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2051	40.327	0,01
				USD 254.119	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2051	204.247	0,04
				USD 41.183	Freddie Mac Pool 2% 1/10/2051	32.940	0,01
				USD 851.755	Freddie Mac Pool 2% 1/10/2051	681.549	0,12
				USD 99.539	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	80.311	0,01
				USD 219.382	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	177.220	0,03
				USD 267.899	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	216.739	0,04
				USD 41.780	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	34.130	0,01
				USD 302.653	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	241.756	0,04
				USD 626.212	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	506.618	0,09

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 459.050	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	375.189	0,07	USD 582.138	Freddie Mac Pool 4% 1/3/2050	547.525	0,10
USD 1.859.106	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	1.496.553	0,27	USD 600.783	Freddie Mac Pool 4% 1/6/2050	559.383	0,10
USD 257.492	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	208.046	0,04	USD 64.280	Freddie Mac Pool 4,5% 1/7/2052	60.991	0,01
USD 87.109	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2052	69.658	0,01	USD 396.084	Freddie Mac Pool 4,5% 1/7/2052	375.802	0,07
USD 73.652	Freddie Mac Pool 2,5% 1/7/2050	61.935	0,01	USD 126.194	Freddie Mac Pool 4,5% 1/8/2052	119.753	0,02
USD 493.256	Freddie Mac Pool 2,5% 1/2/2051	418.778	0,08	USD 91.213	Freddie Mac Pool 5% 1/11/2052	88.511	0,02
USD 370.271	Freddie Mac Pool 2,5% 1/5/2051	315.152	0,06	USD 190.554	Freddie Mac Pool 5% 1/12/2052	185.014	0,03
USD 2.100.036	Freddie Mac Pool 2,5% 1/5/2051	1.766.185	0,32	USD 101.010	Freddie Mac Pool 5% 1/12/2052	98.073	0,02
USD 1.703.840	Freddie Mac Pool 2,5% 1/11/2051	1.432.020	0,26	USD 114.123	Freddie Mac Pool 5% 1/12/2052	110.818	0,02
USD 365.180	Freddie Mac Pool 2,5% 1/11/2051	307.462	0,06	USD 118.212	Freddie Mac Pool 5% 1/1/2053	114.787	0,02
USD 1.140.268	Freddie Mac Pool 2,5% 1/12/2051	956.071	0,17	USD 44.609	Freddie Mac Pool 5% 1/2/2053	43.289	0,01
USD 1.112.488	Freddie Mac Pool 2,5% 1/1/2052	930.159	0,17	USD 141.937	Freddie Mac Pool 5,5% 1/1/2053	140.263	0,03
USD 4.490.918	Freddie Mac Pool 2,5% 1/1/2052	3.755.961	0,68	USD 51.580	Freddie Mac Pool 5,5% 1/1/2053	51.042	0,01
USD 1.302.773	Freddie Mac Pool 2,5% 1/4/2052	1.093.108	0,20	USD 361.282	Freddie Mac Pool 5,5% 1/3/2053	357.341	0,06
USD 17.698	Freddie Mac Pool 3% 1/9/2037	16.099	0,00	USD 397.811	Freddie Mac Pool 5,5% 1/5/2053	393.411	0,07
USD 345.600	Freddie Mac Pool 3% 1/6/2038	318.672	0,06	USD 434.081	Freddie Mac Pool 5,5% 1/5/2053	429.495	0,08
USD 724.995	Freddie Mac Pool 3% 1/6/2044	642.276	0,12	USD 70.802	Freddie Mac Pool 5,5% 1/8/2053	69.965	0,01
USD 141.509	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2047	124.584	0,02	USD 40.267	Freddie Mac Pool 6% 1/11/2052	40.471	0,01
USD 5.324	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2050	4.722	0,00	USD 235.396	Freddie Mac Pool 6% 1/1/2053	236.068	0,04
USD 45.838	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2050	40.425	0,01	USD 127.259	Freddie Mac Pool 6% 1/2/2053	127.629	0,02
USD 12.258	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2050	10.854	0,00	USD 80.432	Freddie Mac Pool 6% 1/3/2053	80.648	0,01
USD 5.960	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2050	5.285	0,00	USD 153.458	Freddie Mac Pool 6% 1/4/2053	153.991	0,03
USD 666.350	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	583.085	0,11	USD 363.318	Freddie Mac Pool 6% 1/5/2053	364.546	0,07
USD 209.945	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	182.233	0,03	USD 134.262	Freddie Mac Pool 6% 1/5/2053	134.856	0,02
USD 862.503	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	751.538	0,14	USD 275.384	Freddie Mac Pool 6% 1/6/2053	276.652	0,05
USD 36.519	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	32.389	0,01	USD 676.009	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	90.116	0,02
USD 305.458	Freddie Mac Pool 3% 1/9/2050	270.940	0,05	USD 323.143	Freddie Mac REMICS 3% 25/2/2052	54.643	0,01
USD 72.512	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2051	63.397	0,01	USD 189.038	Freddie Mac REMICS 3,5% 25/3/2051	32.786	0,01
USD 103.932	Freddie Mac Pool 3% 1/10/2051	90.470	0,02	USD 145.872	Freddie Mac REMICS 4% 25/12/2050	28.431	0,01
USD 53.491	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	46.770	0,01	USD 2.930.339	Freddie Mac Strips 3% 15/10/2052	485.465	0,09
USD 1.305.575	Freddie Mac Pool 3% 1/3/2052	1.138.600	0,21	USD 100.000	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust 3,715% 25/10/2027	91.245	0,02
USD 3.480.323	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2052	3.027.155	0,55	USD 7.624.173	FREMF 2019-KW08 Mortgage Trust 0,1% 25/1/2029	28.208	0,01
USD 136.382	Freddie Mac Pool 3,5% 1/1/2034	129.622	0,02	USD 916.000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7,894% 17/8/2037	920.582	0,17
USD 507.344	Freddie Mac Pool 3,5% 1/5/2035	482.238	0,09	USD 779.000	Gilead Sciences 2,6% 1/10/2040	545.032	0,10
USD 15.564	Freddie Mac Pool 3,5% 1/9/2044	14.236	0,00	USD 250.000	Gilead Sciences 4,15% 1/3/2047	209.505	0,04
USD 304.266	Freddie Mac Pool 3,5% 1/3/2046	276.654	0,05	USD 128.000	Gilead Sciences 5,65% 1/12/2041	130.768	0,02
USD 112.107	Freddie Mac Pool 3,5% 1/9/2046	102.246	0,02	USD 65.690	Ginnie Mae I Pool 3% 15/2/2045	59.394	0,01
USD 49.765	Freddie Mac Pool 3,5% 1/1/2048	45.242	0,01	USD 18.018	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/1/2042	16.724	0,00
USD 517.556	Freddie Mac Pool 3,5% 1/1/2048	470.288	0,09	USD 30.503	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/5/2042	28.310	0,01
USD 202.767	Freddie Mac Pool 3,5% 1/6/2048	184.865	0,03	USD 9.520	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/11/2042	8.836	0,00
USD 983.950	Freddie Mac Pool 3,5% 1/8/2049	898.708	0,16	USD 26.087	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/12/2042	24.212	0,00
USD 134.154	Freddie Mac Pool 3,5% 1/1/2050	121.627	0,02	USD 26.425	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/12/2042	24.530	0,00
USD 355.988	Freddie Mac Pool 3,5% 1/6/2050	321.341	0,06	USD 19.096	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/1/2043	17.720	0,00
USD 497.141	Freddie Mac Pool 3,5% 1/8/2050	450.175	0,08	USD 18.807	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/2/2043	17.452	0,00
USD 38.963	Freddie Mac Pool 4% 1/1/2045	37.032	0,01	USD 24.327	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/4/2043	22.579	0,00
USD 792.130	Freddie Mac Pool 4% 1/1/2045	752.713	0,14	USD 24.906	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/4/2043	23.116	0,00
USD 928.803	Freddie Mac Pool 4% 1/9/2045	882.570	0,16				
USD 141.773	Freddie Mac Pool 4% 1/7/2047	133.748	0,02				
USD 362.064	Freddie Mac Pool 4% 1/4/2048	337.174	0,06				
USD 338.322	Freddie Mac Pool 4% 1/4/2048	320.941	0,06				
USD 301.417	Freddie Mac Pool 4% 1/8/2048	284.679	0,05				
USD 20.260	Freddie Mac Pool 4% 1/5/2049	19.060	0,00				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 19.928	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/4/2043	18.503	0,00	USD 59.416	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2043	55.218	0,01
USD 34.264	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/5/2043	31.812	0,01	USD 197.117	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/2/2044	182.729	0,03
USD 8.843	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/5/2043	8.210	0,00	USD 23.651	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2045	21.834	0,00
USD 25.591	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/5/2043	23.754	0,00	USD 426.470	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2046	393.326	0,07
USD 31.090	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/5/2043	28.849	0,01	USD 1.311.007	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/4/2046	1.209.027	0,22
USD 20.641	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/6/2043	19.158	0,00	USD 44.356	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2046	40.961	0,01
USD 64.553	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/7/2043	59.908	0,01	USD 566.615	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2046	523.535	0,09
USD 21.147	Ginnie Mae I Pool 3,5% 15/7/2043	19.624	0,00	USD 95.585	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2046	88.150	0,02
USD 30.597	Ginnie Mae I Pool 4% 15/3/2041	29.076	0,01	USD 411.711	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2046	379.946	0,07
USD 23.971	Ginnie Mae I Pool 4,5% 15/3/2047	23.333	0,00	USD 15.712	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	14.494	0,00
USD 33.582	Ginnie Mae I Pool 4,5% 15/4/2047	32.660	0,01	USD 17.380	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	16.035	0,00
USD 19.438	Ginnie Mae I Pool 4,5% 15/4/2047	18.968	0,00	USD 13.818	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	12.737	0,00
USD 17.689	Ginnie Mae I Pool 4,5% 15/5/2047	17.298	0,00	USD 34.517	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	31.851	0,01
USD 15.032	Ginnie Mae I Pool 5% 15/12/2038	15.005	0,00	USD 21.741	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	20.045	0,00
USD 19.032	Ginnie Mae I Pool 5% 15/7/2039	18.913	0,00	USD 1.972	Ginnie Mae II Pool 4% 20/4/2039	1.884	0,00
USD 13.589	Ginnie Mae I Pool 5% 15/7/2039	13.427	0,00	USD 5.172	Ginnie Mae II Pool 4% 20/7/2039	4.941	0,00
USD 35.320	Ginnie Mae I Pool 5% 15/12/2040	35.107	0,01	USD 1.484	Ginnie Mae II Pool 4% 20/9/2040	1.418	0,00
USD 1.411.607	Ginnie Mae II Pool 2% 20/8/2050	1.173.735	0,21	USD 36.028	Ginnie Mae II Pool 4% 20/10/2040	34.447	0,01
USD 183.156	Ginnie Mae II Pool 2% 20/11/2050	152.177	0,03	USD 145.854	Ginnie Mae II Pool 4% 20/11/2040	139.395	0,03
USD 1.863.965	Ginnie Mae II Pool 2% 20/1/2051	1.546.068	0,28	USD 32.778	Ginnie Mae II Pool 4% 20/12/2040	31.336	0,01
USD 98.050	Ginnie Mae II Pool 2% 20/2/2051	81.378	0,02	USD 28.252	Ginnie Mae II Pool 4% 20/1/2041	27.012	0,01
USD 971.439	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/4/2051	829.361	0,15	USD 3.711	Ginnie Mae II Pool 4% 20/10/2046	3.496	0,00
USD 731.619	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/10/2051	624.612	0,11	USD 333.627	Ginnie Mae II Pool 4% 20/3/2047	315.664	0,06
USD 504.337	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/12/2051	430.513	0,08	USD 76.649	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2047	72.582	0,01
USD 839.698	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/5/2052	716.341	0,13	USD 119.546	Ginnie Mae II Pool 4% 20/6/2047	113.184	0,02
USD 706.833	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/6/2052	603.263	0,11	USD 143.219	Ginnie Mae II Pool 4% 20/11/2047	135.287	0,02
USD 541.077	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/7/2052	461.799	0,08	USD 70.260	Ginnie Mae II Pool 4% 20/12/2047	66.433	0,01
USD 79.752	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/12/2052	68.071	0,01	USD 57.328	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2050	54.191	0,01
USD 259.497	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/1/2053	221.542	0,04	USD 3.350	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/12/2039	3.280	0,00
USD 382.990	Ginnie Mae II Pool 3% 20/1/2051	339.598	0,06	USD 4.078	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/1/2040	3.991	0,00
USD 868.915	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2051	766.989	0,14	USD 3.335	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/2/2040	3.265	0,00
USD 1.998.409	Ginnie Mae II Pool 3% 20/8/2051	1.763.018	0,32	USD 223	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/5/2040	219	0,00
USD 283.449	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2051	250.051	0,05	USD 1.291	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/7/2040	1.263	0,00
USD 145.018	Ginnie Mae II Pool 3% 20/1/2052	127.657	0,02	USD 2.415	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/10/2040	2.362	0,00
USD 87.178	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/4/2043	80.896	0,01	USD 10.769	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/7/2041	10.388	0,00

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 25.612	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/7/2041	25.054	0,00	USD 68.769	GSAA Home Equity Trust 2006-4 3,644% 25/3/2036	49.106	0,01
USD 58.667	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/9/2048	56.604	0,01	USD 582.319	GSAA Home Equity Trust 2006-5 5,789% 25/3/2036	192.186	0,04
USD 229.467	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/3/2049	221.575	0,04	USD 29.454	GSAA Home Equity Trust 2007-2 5,917% 25/3/2037	5.869	0,00
USD 89.042	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/4/2049	85.985	0,02	USD 50.000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 8,804% 25/2/2047	46.595	0,01
USD 193.201	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/5/2049	186.273	0,03	USD 113.527	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP2 5,779% 25/3/2035	99.015	0,02
USD 60.240	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/8/2050	58.241	0,01	USD 124.854	GSR Mortgage Loan Trust 2006-7F 6,5% 25/8/2036	44.788	0,01
USD 7.551	Ginnie Mae II Pool 5% 20/10/2039	7.609	0,00	USD 32.950	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F 5,5% 25/1/2037	42.333	0,01
USD 18.443	Ginnie Mae II Pool 5% 20/7/2042	18.582	0,00	USD 322.305	GSR Mortgage Loan Trust 2007-OA2 2,929% 25/6/2047	206.647	0,04
USD 1.189	Ginnie Mae II Pool 5% 20/7/2044	1.198	0,00	USD 481.430	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-12 5,838% 19/12/2036	380.097	0,07
USD 71.000	Glencore Funding 2,625% 23/9/2031*	56.555	0,01	USD 747.000	HCA 3,5% 1/9/2030	652.847	0,12
USD 388.000	Glencore Funding 5,7% 8/5/2033	380.237	0,07	USD 1.165.000	HCA 5,875% 1/2/2029	1.171.094	0,21
USD 391.000	Global Payments 3,2% 15/8/2029	340.287	0,06	USD 186.000	HCA 7,69% 15/6/2025	191.300	0,03
USD 122.000	Global Payments 5,3% 15/8/2029	118.970	0,02	USD 31.000	Herc 5,5% 15/7/2027	29.859	0,01
USD 269.000	GLP Capital / GLP Financing II 3,25% 15/1/2032	216.975	0,04	USD 159.000	Hess 5,6% 15/2/2041	150.011	0,03
USD 715.000	GLP Capital / GLP Financing II 4% 15/1/2030	622.858	0,11	USD 261.000	Hewlett Packard Enterprise 5,25% 1/7/2028	258.681	0,05
USD 304.000	GLP Capital / GLP Financing II 5,3% 15/1/2029	286.677	0,05	USD 110.000	Home Equity Asset Trust 2006-3 6,029% 25/7/2036	99.227	0,02
USD 129.000	GLP Capital / GLP Financing II 5,75% 1/6/2028	125.520	0,02	USD 80.345	Home Equity Asset Trust 2007-1 5,729% 25/5/2037	61.439	0,01
USD 838.000	Goldman Sachs 0,657% 10/9/2024	837.213	0,15	USD 436.408	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 5,669% 25/4/2037	283.344	0,05
USD 200.000	Goldman Sachs 1,992% 27/1/2032	155.884	0,03	USD 17.180	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A 3,726% 25/7/2034	16.527	0,00
USD 137.000	Goldman Sachs 2,615% 22/4/2032	110.964	0,02	USD 109.000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3,982% 5/3/2037	98.837	0,02
USD 1.229.000	Goldman Sachs 2,65% 21/10/2032	986.820	0,18	USD 1.326.000	Huntington Ingalls Industries 2,043% 16/8/2028	1.123.950	0,20
USD 973.000	Goldman Sachs 4,223% 1/5/2029	916.004	0,17	USD 1.155.000	Huntington Ingalls Industries 3,483% 1/12/2027	1.063.471	0,19
USD 238.317	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2,31% 20/10/2048	184.048	0,03	USD 179.000	Huntington Ingalls Industries 4,2% 1/5/2030	165.543	0,03
USD 141.275	Government National Mortgage Association 0,923% 16/2/2050	3.286	0,00	USD 3.000	iHeartCommunications 4,75% 15/1/2028	2.316	0,00
USD 1.524.108	Government National Mortgage Association 3% 20/5/2051	223.764	0,04	USD 19.000	iHeartCommunications 5,25% 15/8/2027	15.095	0,00
USD 738.170	Government National Mortgage Association 3% 20/8/2051	111.376	0,02	USD 39.123	Impac Secured Assets Trust 2006-3 5,769% 25/11/2036	34.713	0,01
USD 17.777	Greenpoint Manufactured Housing 8,29% 15/12/2029	17.674	0,00	USD 100.000	IMT Trust 2017-APTS 3,613% 15/6/2034	95.771	0,02
USD 18.562	Greenpoint Manufactured Housing 9,23% 15/12/2029	16.328	0,00	USD 110.000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3,911% 10/7/2035	102.415	0,02
USD 12.490	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 6,43% 25/3/2036	11.017	0,00	USD 100.000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 4,158% 10/7/2035	92.586	0,02
USD 5.000.000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 0,395% 3/5/2032	18.953	0,00	USD 36.229	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 5,669% 25/7/2036	35.327	0,01
USD 100.000	GS Mortgage Trust 2015-590M 3,932% 10/10/2035	83.575	0,02	USD 385.827	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR35 5,789% 25/1/2037	340.417	0,06
USD 100.000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 4,554% 10/7/2048	89.618	0,02	USD 859.514	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 5,659% 25/5/2037	206.732	0,04
USD 110.000	GS Mortgage Trust 2017-GPTX 2,856% 10/5/2034	80.438	0,01	USD 206.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-NINE 2,949% 6/9/2038	173.824	0,03

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 138.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-AON 4,128% 5/7/2031	126.572	0,02	USD 285.000	Los Angeles Unified School District 6,758% 1/7/2034	317.678	0,06
USD 339.180	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-PHH 6,567% 15/6/2035	316.905	0,06	USD 80.000	Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Auth 4,145% 1/2/2033	77.210	0,01
USD 153.514	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A1 5,849% 25/3/2037	141.042	0,03	USD 630.000	Lowe's 2,8% 15/9/2041	433.552	0,08
USD 23.182	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 4,47% 25/5/2037	21.138	0,00	USD 176.000	Lowe's 4,5% 15/4/2030	169.665	0,03
USD 1.030.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2013-LC11 0,652% 15/4/2046	22	0,00	USD 13.287	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 3,279% 20/4/2048	12.809	0,00
USD 100.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4,881% 15/1/2049	84.086	0,02	USD 160.000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4,167% 15/8/2034	122.860	0,02
USD 100.000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 4,29% 15/12/2048	75.583	0,01	USD 143.000	Marsh & McLennan 2,9% 15/12/2051	93.070	0,02
USD 20.000	JPMCC Commercial Mortgage Trust 2017-JP7 4,05% 15/9/2050	17.248	0,00	USD 46.355	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 5,472% 25/8/2037	27.685	0,01
USD 1.800.000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0,75% 15/12/2049	34.985	0,01	USD 6.000	Matador Resources 5,875% 15/9/2026	5.856	0,00
USD 22.000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2018-C8 4,421% 15/6/2051	19.618	0,00	USD 108.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	94.119	0,02
USD 880.000	JPMorgan Chase 2,963% 25/1/2033	731.842	0,13	USD 48.192	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 5,909% 25/5/2037	34.859	0,01
USD 300.000	JPMorgan Chase 4,565% 14/6/2030	286.539	0,05	USD 90.061	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-A3 4,648% 25/5/2036	86.911	0,02
USD 190.000	JPMorgan Chase 5,35% 1/6/2034	188.101	0,03	USD 199.000	Meta Platforms 4,45% 15/8/2052	169.124	0,03
USD 499.305	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A 6,869% 28/7/2042	466.713	0,08	USD 110.000	Meta Platforms 4,65% 15/8/2062	93.513	0,02
USD 329.000	Kinder Morgan Energy Partners 4,7% 1/11/2042	269.313	0,05	USD 55.000	Metropolitan Transportation Authority 5,871% 15/11/2039	55.351	0,01
USD 277.000	Kinder Morgan Energy Partners 5,4% 1/9/2044	241.317	0,04	USD 135.000	Metropolitan Transportation Authority 6,668% 15/11/2039	145.861	0,03
USD 285.000	KLA 3,3% 1/3/2050	205.722	0,04	USD 60.000	Metropolitan Transportation Authority 6,814% 15/11/2040	65.000	0,01
USD 55.000	KLA 5% 15/3/2049	52.133	0,01	USD 2.000	MGM Resorts International 4,625% 1/9/2026	1.886	0,00
USD 84.000	KLA 5,25% 15/7/2062	81.694	0,01	USD 4.000	MGM Resorts International 5,5% 15/4/2027	3.816	0,00
USD 925.980	Ladder Capital Commercial Mortgage 2013-GCP Mortgage Trust 1,322% 15/2/2036	37.459	0,01	USD 4.000	MGM Resorts International 5,75% 15/6/2025	3.952	0,00
USD 4.000	Lamar Media 3,75% 15/2/2028	3.643	0,00	USD 62.000	Moody's 4,875% 17/12/2048	56.585	0,01
USD 225.338	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2001-B 6,63% 15/4/2040	225.423	0,04	USD 411.000	Morgan Stanley 1,794% 13/2/2032	316.416	0,06
USD 118.013	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 5,879% 25/9/2036	102.511	0,02	USD 808.000	Morgan Stanley 2,239% 21/7/2032	635.662	0,12
USD 1.780	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 5,679% 25/3/2037	1.763	0,00	USD 71.000	Morgan Stanley 2,511% 20/10/2032	56.520	0,01
USD 85.972	Lehman XS Trust Series 2007-16N 7,329% 25/9/2047	107.855	0,02	USD 862.000	Morgan Stanley 2,699% 22/1/2031	725.627	0,13
USD 57.354	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 5,729% 25/6/2036	26.964	0,01	USD 596.000	Morgan Stanley 5,164% 20/4/2029	584.240	0,11
USD 610.133	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 5,749% 25/8/2036	243.894	0,04	USD 1.321.000	Morgan Stanley 5,25% 21/4/2034	1.281.932	0,23
USD 110.000	Los Angeles Community College District 6,6% 1/8/2042	127.084	0,02	USD 617.000	Morgan Stanley 5,424% 21/7/2034	607.138	0,11
				USD 746.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	740.812	0,13
				USD 492.000	Morgan Stanley 6,342% 18/10/2033	516.273	0,09
				USD 24.414	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2005-HE1 6,029% 25/12/2034	21.784	0,00
				USD 122.938	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2005-HE5 6,299% 25/9/2035	101.083	0,02

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 27.135	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2007-SEA1 9,229% 25/2/2047	24.797	0,00	USD 142.000	Municipal Electric Authority of Georgia 6,637% 1/4/2057	158.710	0,03
USD 495.000	Morgan Stanley Bank 4,754% 21/4/2026	488.014	0,09	USD 148.224	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 6,5% 25/3/2034	126.349	0,02
USD 260.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1,328% 15/12/2047	3.856	0,00	USD 34.035	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 7,5% 25/3/2034	29.993	0,01
USD 142.589	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14 4,064% 15/2/2047	141.393	0,03	USD 119.000	Nasdaq 5,55% 15/2/2034	118.678	0,02
USD 130.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4,468% 15/5/2048	118.962	0,02	USD 210.000	Nasdaq 6,1% 28/6/2063	206.975	0,04
USD 130.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 4,668% 15/10/2048	119.835	0,02	USD 150.000	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-B 5,839% 25/4/2037	135.229	0,02
USD 500.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 3,72% 15/12/2049	466.702	0,08	USD 120.000	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-SOX 4,404% 17/6/2038	110.177	0,02
USD 20.000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2,73% 15/12/2050	12.175	0,00	USD 13.000	Navient 5,875% 25/10/2024*	12.819	0,00
USD 12.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 4,281% 15/6/2050	9.516	0,00	USD 13.000	Navient 6,75% 25/6/2025	12.917	0,00
USD 107.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	72.514	0,01	USD 13.000	Navient 6,75% 15/6/2026	12.757	0,00
USD 100.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4,419% 11/7/2040	86.321	0,02	USD 76.815	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 2,46% 15/11/2068	70.884	0,01
USD 60.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 6,58% 15/7/2035	59.626	0,01	USD 76.815	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 6,325% 15/11/2068	75.913	0,01
USD 100.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 6,88% 15/7/2035	99.119	0,02	USD 147.000	NBCUniversal Media 4,45% 15/1/2043	128.549	0,02
USD 66.232	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 2006-3 5,749% 25/4/2036	47.649	0,01	USD 237.837	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-C 6,104% 25/12/2035	189.521	0,03
USD 167.213	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-16AX 5,769% 25/11/2036	31.394	0,01	USD 161.000	New Jersey Turnpike Authority 7,414% 1/1/2040	197.831	0,04
USD 56.951	Morgan Stanley Resecuritization Trust 2013-R7 5,732% 26/12/2046	52.330	0,01	USD 115.000	New York City Municipal Water Finance Authority 5,882% 15/6/2044	124.221	0,02
USD 262.932	Mortgage Loan Resecuritization Trust 5,773% 16/4/2036	251.622	0,05	USD 150.000	New York City Municipal Water Finance Authority 6,011% 15/6/2042	164.791	0,03
USD 134.076	MortgageIT Trust 2004-1 6,209% 25/11/2034	128.101	0,02	USD 100.000	New York State Dormitory Authority 5,389% 15/3/2040	100.438	0,02
USD 113.441	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1 4,01% 22/6/2043	103.290	0,02	USD 188.000	Newmont 2,25% 1/10/2030	152.861	0,03
USD 355.309	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 4,2% 22/2/2044	320.571	0,06	USD 29.000	Nexstar Media 5,625% 15/7/2027	27.291	0,01
USD 222.008	Mosaic Solar Loan Trust 2019-2 2,88% 20/9/2040	192.624	0,04	USD 1.003.000	NGPL PipeCo 3,25% 15/7/2031	823.610	0,15
USD 46.251	Mosaic Solar Loan Trust 2020-1 2,1% 20/4/2046	39.506	0,01	USD 280.000	NGPL PipeCo 4,875% 15/8/2027	268.101	0,05
USD 86.274	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4,38% 21/1/2053	80.203	0,01	USD 214.000	NiSource 5,25% 30/3/2028	213.033	0,04
USD 286.000	Motorola Solutions 2,75% 24/5/2031	232.072	0,04	USD 160.000	NiSource 5,4% 30/6/2033	158.639	0,03
USD 198.000	Motorola Solutions 5,5% 1/9/2044	181.450	0,03	USD 81.000	NNN REIT 3,5% 15/4/2051	54.670	0,01
USD 344.000	Motorola Solutions 5,6% 1/6/2032	339.421	0,06	USD 112.420	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 7% 19/2/2030	107.938	0,02
USD 127.942	MSCG Trust 2018-SELF 7,508% 15/10/2037	125.249	0,02	USD 2.282.328	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 6,408% 25/5/2036	517.013	0,09
USD 447.797	MSCG Trust 2018-SELF 8,408% 15/10/2037	439.506	0,08	USD 400.000	Norfolk Southern 2,9% 25/8/2051	255.471	0,05
USD 323.000	MSCI 3,25% 15/8/2033	260.101	0,05	USD 206.000	Norfolk Southern 3,05% 15/5/2050	137.748	0,03
USD 421.000	MSCI 3,875% 15/2/2031	367.695	0,06	USD 250.000	Norfolk Southern 3,155% 15/5/2055	165.544	0,03
USD 115.000	MSCI 4% 15/11/2029	103.511	0,02	USD 258.000	Northern States Power 2,9% 1/3/2050	170.192	0,03
				USD 250.000	Northern States Power 3,2% 1/4/2052	170.402	0,03
				USD 149.000	Northern States Power 4% 15/8/2045	118.518	0,02
				USD 737.000	Northwest Pipeline 4% 1/4/2027	700.863	0,13
				USD 110.000	NRG Energy 2,45% 2/12/2027	93.328	0,02
				USD 19.000	NRG Energy 5,25% 15/6/2029	17.086	0,00
				USD 21.000	NRG Energy 5,75% 15/1/2028	19.963	0,00
				USD 22.349	Oakwood Mortgage Investors 6,93% 15/9/2031	11.990	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 172.488	Oakwood Mortgage Investors 7,475% 15/8/2027	139.778	0,03	USD 200.000	Pacific Gas and Electric 3,95% 1/12/2047	133.532	0,02
USD 101.335	Oakwood Mortgage Investors 7,62% 15/6/2032	88.969	0,02	USD 138.000	Pacific Gas and Electric 4,95% 1/7/2050	107.164	0,02
USD 171.000	Occidental Petroleum 6,45% 15/9/2036	174.502	0,03	USD 45.000	Pacific Gas and Electric 6,7% 1/4/2053	43.931	0,01
USD 181.000	Occidental Petroleum 7,875% 15/9/2031	200.631	0,04	USD 115.000	PECO Energy 2,8% 15/6/2050	73.242	0,01
USD 114.000	Ohio Power 1,625% 15/1/2031	89.201	0,02	USD 111.000	PECO Energy 2,85% 15/9/2051	70.355	0,01
USD 248.000	Ohio Power 2,9% 1/10/2051	158.301	0,03	USD 376.000	PECO Energy 3,05% 15/3/2051	251.128	0,04
USD 226.000	Ohio Power 4% 1/6/2049	177.464	0,03	USD 402.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 5,875% 15/11/2027	399.509	0,07
USD 410.000	Ohio Power 5% 1/6/2033	399.679	0,07	USD 27.000	Performance Food 5,5% 15/10/2027	25.935	0,00
USD 259.000	Oncor Electric Delivery 3,1% 15/9/2049	176.212	0,03	USD 137.000	Philip Morris International 5,125% 17/11/2027	136.614	0,02
USD 2.450.000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 0% 10/2/2032	82	0,00	USD 71.000	Piedmont Natural Gas 4,1% 18/9/2034	60.870	0,01
USD 490.000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 0,218% 10/2/2032	1.279	0,00	USD 106.000	Pioneer Natural Resources 2,15% 15/1/2031	85.937	0,01
USD 685.000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3,14% 14/10/2036	628.689	0,11	USD 80.000	Port Authority of New York & New Jersey 4,926% 1/10/2051	77.133	0,01
USD 120.000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 2,76% 14/9/2035	104.329	0,02	USD 145.000	Port Authority of New York & New Jersey 4,96% 1/8/2046	138.273	0,03
USD 310.000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 3,45% 14/9/2035	266.271	0,05	USD 20.000	Post 5,5% 15/12/2029	18.570	0,00
USD 49.204	OneMain Financial Issuance Trust 2020-A 3,84% 14/5/2032	49.084	0,01	USD 25.000	Post 5,625% 15/1/2028	24.126	0,00
USD 246.000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 5,94% 16/6/2036	240.850	0,04	USD 277.394	PRPM 2020-4 2,951% 25/10/2025	272.858	0,05
USD 229.000	ONEOK 6,625% 1/9/2053	231.847	0,04	USD 241.000	Public Service Electric and Gas 2,05% 1/8/2050	135.992	0,02
USD 4.000	OPENLANE 5,125% 1/6/2025	3.869	0,00	USD 430.000	Public Service Electric and Gas 2,45% 15/1/2030	368.991	0,07
USD 190.000	Option One Mortgage Loan Trust 2005-4 Asset-Backed Certificates Series 2005-4 6,164% 25/11/2035	155.754	0,03	USD 152.000	Public Service Electric and Gas 3,15% 1/1/2050	107.329	0,02
USD 353.064	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5,866% 25/1/2037	282.879	0,05	USD 210.000	Public Service of New Hampshire 5,15% 15/1/2053	205.149	0,04
USD 237.473	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5,866% 25/1/2037	195.656	0,04	USD 130.528	RAMP Series 2004-RS7 Trust 4,681% 25/7/2034	101.336	0,02
USD 98.422	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 5,82% 25/3/2037	85.482	0,02	USD 184.046	RASC Series 2006-EMX9 Trust 5,909% 25/11/2036	146.010	0,03
USD 1.016.000	Oracle 3,6% 1/4/2040	770.344	0,14	USD 1.103.431	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7,867% 25/10/2039	1.104.200	0,20
USD 121.000	Oracle 3,85% 15/7/2036	100.305	0,02	USD 219.002	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 7,782% 25/6/2037	219.423	0,04
USD 655.000	Oracle 4% 15/7/2046	492.179	0,09	USD 108.000	Realty Income 4,65% 15/3/2047	94.117	0,02
USD 231.000	Oracle 4% 15/11/2047	172.795	0,03	USD 14.574	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R2 5,769% 25/6/2035	13.366	0,00
USD 424.000	Oracle 4,125% 15/5/2045	328.244	0,06	USD 186.000	Republic Services 2,375% 15/3/2033	147.945	0,03
USD 240.000	Oracle 4,375% 15/5/2055	184.798	0,03	USD 217.810	RFMSI Series 2006-SA2 Trust 5,341% 25/8/2036	154.725	0,03
USD 283.000	Otis Worldwide 5,25% 16/8/2028	284.756	0,05	USD 22.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	20.426	0,00
USD 3.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	2.441	0,00	USD 68.000	Ryder System 5,25% 1/6/2028	67.111	0,01
USD 34.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	30.806	0,01	USD 120.000	Ryder System 5,65% 1/3/2028	120.238	0,02
USD 74.892	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 6,5% 25/1/2037	64.305	0,01	USD 1.639.000	Sabine Pass Liquefaction 5,625% 1/3/2025	1.633.316	0,29
USD 1.379.000	Pacific Gas and Electric 3,5% 1/8/2050	869.599	0,16	USD 100.000	Sabine Pass Liquefaction 5,75% 15/5/2024	99.810	0,02
				USD 1.368.000	Sabine Pass Liquefaction 5,875% 30/6/2026	1.373.275	0,25
				USD 52.000	Sabine Pass Liquefaction 5,9% 15/9/2037	52.256	0,01

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 544.000	San Diego Gas & Electric 5,35% 1/4/2053	528.236	0,10	USD 1.170.543	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust Series 2007-6 4,348% 25/7/2037	762.890	0,14
USD 130.889	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0% 25/7/2056	13.806	0,00	USD 758.835	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 6% 25/10/2036	429.206	0,08
USD 43.357	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2007-BR1 5,649% 25/2/2037	18.392	0,00	USD 17.000	Sunoco / Sunoco Finance 4,5% 30/4/2030	15.163	0,00
USD 461.988	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2007-BR1 5,969% 25/2/2037	195.958	0,04	USD 246.000	Targa Resources 4,2% 1/2/2033	216.978	0,04
USD 15.000	Select Medical 6,25% 15/8/2026	14.869	0,00	USD 154.000	Targa Resources 6,125% 15/3/2033	156.770	0,03
USD 70.799	Sequoia Mortgage Trust 2007-3 3,922% 20/7/2037	57.006	0,01	USD 341.000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 4,875% 1/2/2031	313.419	0,06
USD 17.000	Service Properties Trust 4,35% 1/10/2024	16.369	0,00	USD 563.000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 5% 15/1/2028	542.530	0,10
USD 37.559	SG Mortgage Trust 2006-FRE2 5,749% 25/7/2036	7.936	0,00	USD 243.000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 5,5% 1/3/2030	233.801	0,04
USD 33.000	Sirius XM Radio 5,5% 1/7/2029	29.767	0,01	USD 5.000	TEGNA 4,625% 15/3/2028	4.490	0,00
USD 16.000	Six Flags Entertainment 5,5% 15/4/2027	15.054	0,00	USD 6.000	TEGNA 5% 15/9/2029	5.296	0,00
USD 2.525	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B 5,882% 15/3/2024	2.524	0,00	USD 29.000	Tenet Healthcare 4,375% 15/1/2030	25.721	0,00
USD 653.366	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10,175% 15/10/2041	691.440	0,13	USD 640.000	Texas Eastern Transmission 3,5% 15/1/2028	590.926	0,11
USD 100.000	SMB Private Education Loan Trust 2014-A 4,5% 15/9/2045	85.205	0,02	USD 199.000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/10/2031	160.449	0,03
USD 532.536	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 1,6% 15/9/2054	474.583	0,09	USD 348.000	Thermo Fisher Scientific 5,086% 10/8/2033	349.812	0,06
USD 320.000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2,5% 15/9/2054	253.294	0,05	USD 2.174	Thornburg Mortgage Trust 2007-3 7,376% 25/6/2047	2.118	0,00
USD 507.082	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2,99% 15/1/2053	421.878	0,08	USD 546.000	T-Mobile USA 3,875% 15/4/2030	497.988	0,09
USD 145.100	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3,86% 15/1/2053	131.341	0,02	USD 597.000	Transcontinental Gas Pipe Line 4% 15/3/2028	562.552	0,10
USD 120.917	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3,86% 15/1/2053	108.679	0,02	USD 338.000	Transcontinental Gas Pipe Line 4,6% 15/3/2048	282.639	0,05
USD 907.000	Southern California Edison 2,25% 1/6/2030	754.245	0,14	USD 400.000	Tricon American Homes 2017-SFR2 Trust 5,104% 17/1/2036	395.655	0,07
USD 426.000	Southern California Edison 5,95% 1/11/2032	441.849	0,08	USD 200.000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C7 3,679% 15/12/2050	181.183	0,03
USD 487.000	Southwestern Public Service 3,15% 1/5/2050	322.870	0,06	USD 99.000	Union Electric 5,45% 15/3/2053	97.475	0,02
USD 1.363.000	Sprint 7,125% 15/6/2024	1.374.385	0,25	USD 156.000	Union Pacific 3,55% 20/5/2061	110.602	0,02
USD 550.000	Sprint 7,625% 15/2/2025	561.503	0,10	USD 203.000	Union Pacific 3,75% 5/2/2070	148.243	0,03
USD 449.000	Sprint 7,625% 1/3/2026	465.942	0,08	USD 156.000	Union Pacific 3,95% 15/8/2059	121.426	0,02
USD 148.000	Sprint 7,875% 15/9/2023	147.902	0,03	USD 112.000	Union Pacific 5,15% 20/1/2063	107.567	0,02
USD 5.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	4.609	0,00	USD 110.465	Union Pacific Railroad 2014-1 Pass Through Trust 3,227% 14/5/2026	104.810	0,02
USD 13.000	Standard Industries 5% 15/2/2027	12.368	0,00	USD 168.543	United Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 4% 11/4/2026	160.707	0,03
USD 300.000	State of California 4,6% 1/4/2038	282.247	0,05	USD 7.934	United Airlines 2016-2 Class B Pass Through Trust 3,65% 7/10/2025	7.488	0,00
USD 310.000	State of California 7,55% 1/4/2039	380.868	0,07	USD 188.979	United Airlines 2019-2 Class AA Pass Through Trust 2,7% 1/5/2032	159.466	0,03
USD 360.000	State of Illinois 5,1% 1/6/2033	349.385	0,06	USD 113.138	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026	108.895	0,02
USD 155.000	State of Texas 5,517% 1/4/2039	161.890	0,03	USD 725.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,5% 15/2/2053	669.666	0,12
USD 163.943	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust Series 2007-3 4,196% 25/4/2047	77.801	0,01	USD 2.522.000	United States Treasury Note/ Bond 0,25% 30/6/2025	2.316.398	0,42
				USD 5.268.000	United States Treasury Note/ Bond 0,25% 31/7/2025	4.822.484	0,87

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 11.911.000	United States Treasury Note/ Bond 0,375% 30/4/2025	11.031.168	1,99	USD 327.000	United States Treasury Note/ Bond 2,25% 15/2/2052	220.802	0,04
USD 1.305.500	United States Treasury Note/ Bond 0,375% 30/9/2027	1.111.562	0,20	USD 1.542.000	United States Treasury Note/ Bond 2,375% 15/5/2027	1.433.397	0,26
USD 3.158.000	United States Treasury Note/ Bond 0,5% 28/2/2026	2.849.232	0,51	USD 619.000	United States Treasury Note/ Bond 2,375% 31/3/2029	560.872	0,10
USD 2.403.000	United States Treasury Note/ Bond 0,5% 31/5/2027	2.079.534	0,38	USD 307.000	United States Treasury Note/ Bond 2,375% 15/5/2029	277.859	0,05
USD 3.548.500	United States Treasury Note/ Bond 0,5% 31/8/2027	3.045.472	0,55	USD 992.000	United States Treasury Note/ Bond 2,375% 15/2/2042	737.800	0,13
USD 1.681.000	United States Treasury Note/ Bond 0,625% 31/7/2026	1.501.737	0,27	USD 2.009.200	United States Treasury Note/ Bond 2,375% 15/5/2051	1.397.493	0,25
USD 877.000	United States Treasury Note/ Bond 0,75% 30/4/2026	792.486	0,14	USD 3.101.000	United States Treasury Note/ Bond 2,5% 15/2/2045*†	2.276.570	0,41
USD 626.000	United States Treasury Note/ Bond 0,75% 31/5/2026	564.060	0,10	USD 2.611.000	United States Treasury Note/ Bond 2,625% 15/4/2025	2.512.068	0,45
USD 3.158.000	United States Treasury Note/ Bond 0,875% 30/6/2026	2.852.315	0,52	USD 307.000	United States Treasury Note/ Bond 2,625% 15/2/2029	282.404	0,05
USD 159.000	United States Treasury Note/ Bond 1% 31/7/2028	135.883	0,02	USD 2.592.100	United States Treasury Note/ Bond 2,75% 15/5/2025	2.496.213	0,45
USD 770.000	United States Treasury Note/ Bond 1,125% 15/5/2040	477.099	0,09	USD 6.170.000	United States Treasury Note/ Bond 2,75% 15/8/2032	5.535.647	1,00
USD 770.000	United States Treasury Note/ Bond 1,125% 15/8/2040	473.009	0,09	USD 3.101.000	United States Treasury Note/ Bond 2,75% 15/11/2047	2.348.886	0,42
USD 5.222.000	United States Treasury Note/ Bond 1,25% 15/8/2031	4.215.949	0,76	USD 2.500.000	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/6/2025	2.409.863	0,44
USD 552.000	United States Treasury Note/ Bond 1,25% 15/5/2050	288.776	0,05	USD 258.800	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/5/2032	235.094	0,04
USD 770.000	United States Treasury Note/ Bond 1,375% 15/11/2040	491.777	0,09	USD 2.731.000	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/5/2043	2.174.879	0,39
USD 2.489.600	United States Treasury Note/ Bond 1,375% 15/8/2050	1.346.815	0,24	USD 1.669.000	United States Treasury Note/ Bond 2,875% 15/11/2046*	1.298.886	0,23
USD 6.443.000	United States Treasury Note/ Bond 1,5% 31/10/2024	6.169.676	1,11	USD 1.340.300	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/5/2047	1.065.539	0,19
USD 2.500.000	United States Treasury Note/ Bond 1,5% 15/2/2025	2.372.852	0,43	USD 4.598.000	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/2/2048*	3.650.740	0,66
USD 4.839.000	United States Treasury Note/ Bond 1,5% 15/8/2026	4.431.088	0,80	USD 4.897.500	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/2/2049	3.889.878	0,70
USD 890.000	United States Treasury Note/ Bond 1,5% 15/2/2030	754.397	0,14	USD 3.025.500	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/8/2052	2.413.191	0,44
USD 3.362.000	United States Treasury Note/ Bond 1,625% 30/11/2026	3.071.502	0,56	USD 1.200.000	United States Treasury Note/ Bond 3,125% 15/11/2028	1.135.125	0,21
USD 1.586.000	United States Treasury Note/ Bond 1,625% 15/8/2029	1.372.324	0,25	USD 1.739.000	United States Treasury Note/ Bond 3,125% 15/2/2043	1.444.151	0,26
USD 3.099.000	United States Treasury Note/ Bond 1,625% 15/5/2031	2.593.899	0,47	USD 1.305.000	United States Treasury Note/ Bond 3,125% 15/8/2044	1.073.617	0,19
USD 1.305.500	United States Treasury Note/ Bond 1,625% 15/11/2050	755.966	0,14	USD 5.268.000	United States Treasury Note/ Bond 3,5% 15/9/2025	5.127.040	0,93
USD 6.443.000	United States Treasury Note/ Bond 1,75% 31/12/2024	6.157.973	1,11	USD 2.500.000	United States Treasury Note/ Bond 3,625% 31/5/2030	2.430.273	0,44
USD 99.000	United States Treasury Note/ Bond 1,875% 28/2/2029	87.456	0,02	USD 2.984.000	United States Treasury Note/ Bond 3,625% 15/8/2043	2.667.358	0,48
USD 138.000	United States Treasury Note/ Bond 1,875% 15/2/2032	115.931	0,02	USD 2.239.500	United States Treasury Note/ Bond 3,625% 15/2/2053*	2.019.049	0,37
USD 992.000	United States Treasury Note/ Bond 1,875% 15/2/2051	612.521	0,11	USD 840.500	United States Treasury Note/ Bond 3,625% 15/5/2053	758.551	0,14
USD 1.252.000	United States Treasury Note/ Bond 1,875% 15/11/2051	769.882	0,14	USD 1.739.000	United States Treasury Note/ Bond 3,75% 15/11/2043	1.581.675	0,29
USD 2.963.900	United States Treasury Note/ Bond 2% 15/2/2025	2.834.345	0,51	USD 2.864.800	United States Treasury Note/ Bond 3,875% 31/3/2025	2.811.309	0,51
USD 861.000	United States Treasury Note/ Bond 2% 15/11/2026	796.391	0,14	USD 2.513.000	United States Treasury Note/ Bond 3,875% 30/11/2027	2.464.114	0,45
USD 29.000	United States Treasury Note/ Bond 2% 15/2/2050	18.584	0,00	USD 5.696.000	United States Treasury Note/ Bond 3,875% 30/9/2029	5.577.408	1,01
USD 3.667.000	United States Treasury Note/ Bond 2,125% 15/5/2025	3.493.677	0,63	USD 4.661.000	United States Treasury Note/ Bond 3,875% 31/12/2029	4.563.410	0,82
USD 5.746.000	United States Treasury Note/ Bond 2,25% 15/8/2027	5.300.012	0,96	USD 483.000	United States Treasury Note/ Bond 3,875% 15/8/2040	458.746	0,08
USD 1.681.000	United States Treasury Note/ Bond 2,25% 15/8/2049	1.144.393	0,21	USD 322.500	United States Treasury Note/ Bond 3,875% 15/2/2043	300.076	0,05

† Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.921.000	United States Treasury Note/ Bond 4% 15/12/2025	2.871.594	0,52	USD 123.000	Virginia Electric and Power 4,45% 15/2/2044	104.223	0,02
USD 5.673.000	United States Treasury Note/ Bond 4% 31/10/2029	5.592.115	1,01	USD 34.000	Vistra Operations 5% 31/7/2027	31.875	0,01
USD 1.245.000	United States Treasury Note/ Bond 4% 15/11/2052	1.202.106	0,22	USD 26.000	Vistra Operations 5,5% 1/9/2026	25.113	0,00
USD 845.000	United States Treasury Note/ Bond 4,125% 15/8/2053	834.107	0,15	USD 800.000	VNDO Trust 2016-350P 4,033% 10/1/2035	699.281	0,13
USD 3.099.100	United States Treasury Note/ Bond 4,25% 31/8/2030	3.083.362	0,56	USD 877.740	Voyager OPTONE Delaware Trust 7,495% 25/2/2038	210.333	0,04
USD 452.000	United States Treasury Note/ Bond 4,25% 15/5/2039	453.642	0,08	USD 44.625	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE3 Trust 5,669% 25/5/2037	38.204	0,01
USD 483.000	United States Treasury Note/ Bond 4,25% 15/11/2040	481.311	0,09	USD 270.532	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust 5,43% 25/2/2046	236.776	0,04
USD 452.000	United States Treasury Note/ Bond 4,375% 15/11/2039	458.727	0,08	USD 24.255	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR5 Trust 5,42% 25/6/2046	21.142	0,00
USD 1.305.500	United States Treasury Note/ Bond 4,375% 15/5/2040	1.322.074	0,24	USD 172.633	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 5,18% 25/6/2047	139.499	0,03
USD 840.500	United States Treasury Note/ Bond 4,375% 15/5/2041	847.001	0,15	USD 62.150	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5,5% 25/11/2035	42.704	0,01
USD 2.975.000	United States Treasury Note/ Bond 4,5% 15/7/2026	2.967.098	0,54	USD 24.597	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5,5% 25/11/2035	18.719	0,00
USD 3.062.000	United States Treasury Note/ Bond 4,5% 15/8/2039	3.157.568	0,57	USD 123.596	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust 6,5% 25/2/2036	99.290	0,02
USD 483.000	United States Treasury Note/ Bond 4,625% 15/2/2040	504.603	0,09	USD 145.468	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6% 25/4/2036	129.474	0,02
USD 840.500	United States Treasury Note/ Bond 4,75% 15/2/2041	888.172	0,16	USD 47.352	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 7% 25/5/2036	37.959	0,01
USD 404.000	UnitedHealth 2,9% 15/5/2050	268.874	0,05	USD 259.098	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust 4,298% 25/10/2036	82.313	0,02
USD 156.000	UnitedHealth 3,75% 15/10/2047	123.448	0,02	USD 202.835	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA3 Trust 5,68% 25/4/2047	171.496	0,03
USD 443.000	UnitedHealth 3,875% 15/8/2059	343.259	0,06	USD 237.647	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 5,789% 25/9/2036	66.308	0,01
USD 75.000	UnitedHealth 4,75% 15/5/2052	68.398	0,01	USD 121.849	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 4,162% 25/10/2036	90.268	0,02
USD 113.000	University of California 4,858% 15/5/2112	99.470	0,02	USD 95.000	Waste Management 2,95% 1/6/2041	68.491	0,01
USD 140.000	Verizon Communications 1,5% 18/9/2030	109.391	0,02	USD 151.000	Waste Management 4,875% 15/2/2034	147.334	0,03
USD 337.000	Verizon Communications 1,75% 20/1/2031	262.335	0,05	USD 13.000	Waste Pro USA 5,5% 15/2/2026	12.267	0,00
USD 1.479.000	Verizon Communications 2,355% 15/3/2032	1.169.947	0,21	USD 461.000	Wells Fargo 5,389% 24/4/2034	449.260	0,08
USD 192.000	Verizon Communications 2,55% 21/3/2031	157.992	0,03	USD 1.323.000	Wells Fargo 5,557% 25/7/2034	1.306.756	0,24
USD 179.000	Verizon Communications 2,65% 20/11/2040	119.725	0,02	USD 943.000	Wells Fargo 5,574% 25/7/2029	938.477	0,17
USD 267.000	Verizon Communications 2,987% 30/10/2056	159.810	0,03	USD 521.000	Wells Fargo Bank 5,45% 7/8/2026*	523.127	0,10
USD 164.000	Verizon Communications 3% 20/11/2060	96.140	0,02				
USD 197.000	Verizon Communications 4,4% 1/11/2034	178.388	0,03				
USD 342.000	Verizon Communications 4,5% 10/8/2033	316.068	0,06				
USD 262.000	VICI Properties 4,75% 15/2/2028	249.291	0,05				
USD 858.000	VICI Properties / VICI Note 3,75% 15/2/2027	787.734	0,14				
USD 721.000	VICI Properties / VICI Note 4,125% 15/8/2030	631.588	0,11				
USD 605.000	VICI Properties / VICI Note 4,25% 1/12/2026	570.185	0,10				
USD 16.000	VICI Properties / VICI Note 4,5% 1/9/2026	15.159	0,00				
USD 1.416.000	VICI Properties / VICI Note 4,625% 1/12/2029	1.278.857	0,23				
USD 56.000	VICI Properties / VICI Note 5,625% 1/5/2024	55.612	0,01				
USD 25.000	VICI Properties / VICI Note 5,75% 1/2/2027	24.502	0,00				
USD 516.000	Viper Energy Partners 5,375% 1/11/2027	497.677	0,09				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
CAD	108.626	EUR	74.000	UBS	18/9/2023	(30)
CAD	38.129	USD	28.000	JP Morgan	18/9/2023	190
CAD	38.000	JPY	4.090.622	JP Morgan	15/9/2023	56
CLP	110.527.500	USD	127.000	Citigroup	15/9/2023	2.188
CLP	12.139.400	USD	14.000	BNP Paribas	15/9/2023	189
CLP	60.271.764	USD	70.000	JP Morgan	15/9/2023	449
CLP	72.702.000	USD	84.000	Toronto-Dominion	15/9/2023	978
CLP	11.838.582	USD	14.000	Goldman Sachs	15/9/2023	(163)
CLP	12.030.060	USD	14.000	Barclays	15/9/2023	61
COP	331.022.286	USD	78.005	BNY Mellon	20/12/2023	369
COP	222.596.000	GBP	44.000	Citigroup	18/9/2023	(1.824)
COP	562.857.000	USD	130.201	Morgan Stanley	15/8/2024	(2.272)
COP	410.157.000	USD	99.000	Standard Chartered Bank	18/9/2023	420
COP	230.608.000	USD	56.000	Bank of America	18/9/2023	(102)
COP	231.336.000	USD	56.000	Citigroup	18/9/2023	74
EUR	500.000	GBP	429.272	UBS	20/9/2023	(1.314)
EUR	1.410.000	USD	1.544.961	JP Morgan	20/9/2023	(14.003)
EUR	610.000	GBP	525.483	Bank of America	20/9/2023	(3.848)
EUR	710.000	USD	777.401	Deutsche Bank	20/9/2023	(6.491)
EUR	930.000	USD	1.019.192	HSBC Bank	20/9/2023	(9.410)
EUR	100.000	USD	109.426	Société Générale	20/9/2023	(847)
EUR	200.000	GBP	171.412	HSBC Bank	20/9/2023	(149)
EUR	250.000	USD	275.009	Citigroup	20/9/2023	(3.562)
EUR	170.000	USD	188.063	Goldman Sachs	20/9/2023	(3.480)
EUR	110.000	USD	121.022	Bank of America	20/9/2023	(1.586)
EUR	10.000	PLN	44.640	HSBC Bank	18/9/2023	28
EUR	88.000	USD	95.946	Citigroup	18/9/2023	(406)
EUR	895.000	USD	979.616	Credit Agricole	20/9/2023	(7.837)
EUR	65.000	USD	70.200	JP Morgan	18/9/2023	369
GBP	679.311	EUR	790.000	HSBC Bank	20/9/2023	3.419
GBP	170.000	USD	218.105	Deutsche Bank	20/9/2023	(2.589)
GBP	172.499	EUR	200.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.527
GBP	150.000	USD	193.010	HSBC Bank	20/9/2023	(2.849)
GBP	275.969	EUR	320.000	Bank of America	20/9/2023	2.406
GBP	45.000	USD	56.943	JP Morgan	18/9/2023	105
GBP	45.000	USD	56.949	Morgan Stanley	18/9/2023	99
HUF	19.919.943	USD	56.000	Deutsche Bank	18/9/2023	665
IDR	5.983.024.462	USD	402.735	UBS	20/9/2023	(9.972)
IDR	1.376.550.000	USD	90.000	Barclays	18/9/2023	368
IDR	1.109.141.980	USD	72.313	Barclays	26/9/2023	491
INR	6.950.076	USD	84.000	Citigroup	18/9/2023	(50)
JPY	351.387.045	USD	2.565.000	Morgan Stanley	20/9/2023	(154.625)
JPY	60.000.000	USD	419.460	HSBC Bank	20/9/2023	(7.883)
JPY	6.630.718	EUR	42.000	HSBC Bank	15/9/2023	(144)
JPY	14.177.511	USD	98.000	HSBC Bank	15/9/2023	(826)
JPY	4.080.511	CAD	38.000	JP Morgan	15/9/2023	(125)
JPY	4.058.149	USD	28.000	JP Morgan	15/9/2023	(185)
JPY	31.000.000	USD	213.159	Barclays	20/9/2023	(512)
JPY	13.000.000	USD	89.225	JP Morgan	20/9/2023	(50)
KRW	68.998.800	USD	52.000	Citigroup	18/9/2023	210
MXN	978.750	USD	57.000	JP Morgan	15/9/2023	1.372
MXN	717.367	GBP	33.000	JP Morgan	18/9/2023	926
MXN	717.325	GBP	33.000	UBS	18/9/2023	923
MXN	2.868.660	USD	169.000	Goldman Sachs	18/9/2023	1.996
MXN	438.574	USD	26.000	Toronto-Dominion	18/9/2023	142
MYR	494.424	USD	108.000	Barclays	18/9/2023	(1.336)
NOK	596.641	USD	57.000	Deutsche Bank	15/9/2023	(952)
NOK	595.560	USD	56.000	Deutsche Bank	18/9/2023	(48)
NOK	297.186	USD	28.000	Goldman Sachs	18/9/2023	(80)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
NOK	596.437	USD	56.000	JP Morgan	18/9/2023	34
PLN	172.616	USD	42.000	Citigroup	18/9/2023	(126)
SEK	607.354	USD	56.000	UBS	18/9/2023	(288)
THB	5.727.312	USD	162.500	Goldman Sachs	18/9/2023	1.283
USD	180.884	JPY	25.228.000	BNY Mellon	20/9/2023	7.830
USD	255.705	CAD	337.000	Bank of America	20/9/2023	6.542
USD	974.691	EUR	890.000	HSBC Bank	20/9/2023	8.341
USD	218.272	GBP	170.000	JP Morgan	20/9/2023	2.756
USD	212.858	AUD	310.000	Bank of America	20/9/2023	11.937
USD	170.544	GBP	133.000	BNP Paribas	20/9/2023	1.935
USD	3.790.891	EUR	3.454.499	BNP Paribas	20/9/2023	40.045
USD	2.151.686	EUR	1.960.501	Toronto-Dominion	20/9/2023	23.001
USD	173.457	EUR	157.904	Deutsche Bank	22/9/2023	1.992
USD	835.976	EUR	762.000	Deutsche Bank	20/9/2023	8.608
USD	823.029	EUR	750.000	JP Morgan	20/9/2023	8.691
USD	209.200	IDR	3.132.765.717	Citigroup	26/9/2023	3.564
USD	174.989	EUR	160.000	Société Générale	20/9/2023	1.263
USD	315.447	COP	1.372.432.310	Bank of America	20/12/2023	(9.494)
USD	79.000	TWD	2.457.690	BNP Paribas	11/10/2023	1.754
USD	978.156	EUR	900.000	Barclays	20/9/2023	949
USD	2.565.000	JPY	365.828.046	Deutsche Bank	20/9/2023	55.565
USD	415.500	EUR	380.000	Citigroup	20/9/2023	2.901
USD	191.929	GBP	150.000	Barclays	20/9/2023	1.768
USD	534.768	JPY	77.000.000	HSBC Bank	20/9/2023	6.577
USD	169.586	ZAR	3.199.553	Toronto-Dominion	7/11/2023	287
USD	56.767	EUR	51.648	UBS	7/11/2023	553
USD	17.516	COP	74.093.632	Citigroup	20/12/2023	(26)
USD	14.000	COP	57.475.880	Barclays	18/9/2023	68
USD	14.000	BRL	68.532	Credit Agricole	5/9/2023	92
USD	99.000	COP	397.935.000	Citigroup	18/9/2023	2.542
USD	70.000	CLP	59.731.000	Morgan Stanley	15/9/2023	184
USD	139.875	COP	562.857.000	Morgan Stanley	15/9/2023	3.305
USD	57.000	CLP	48.655.200	BNP Paribas	15/9/2023	130
USD	57.000	NOK	597.732	Deutsche Bank	15/9/2023	849
USD	56.000	CAD	75.405	Deutsche Bank	18/9/2023	250
USD	42.000	PLN	171.783	HSBC Bank	18/9/2023	328
USD	197.000	MXN	3.366.682	JP Morgan	18/9/2023	(3.682)
USD	86.000	CNH	624.636	Goldman Sachs	18/9/2023	82
USD	8.415	AUD	13.000	Citigroup	18/9/2023	(10)
USD	41.000	JPY	5.931.408	HSBC Bank	15/9/2023	345
USD	57.000	MXN	980.684	JP Morgan	15/9/2023	(1.487)
USD	84.000	JPY	12.229.283	JP Morgan	15/9/2023	179
USD	14.000	ZAR	269.381	Goldman Sachs	18/9/2023	(319)
USD	56.000	MXN	966.952	Citigroup	18/9/2023	(1.638)
USD	56.000	COP	231.560.000	Standard Chartered Bank	18/9/2023	(128)
USD	42.802	AUD	66.000	JP Morgan	18/9/2023	28
USD	56.000	THB	1.983.520	BNP Paribas	18/9/2023	(722)
USD	185.792	JPY	27.000.000	Bank of America	20/9/2023	583
USD	83.862	GBP	66.000	JP Morgan	18/9/2023	192
USD	73.142	AUD	114.000	Deutsche Bank	18/9/2023	(740)
USD	42.000	ZAR	786.873	Barclays	18/9/2023	175
USD	14.000	BRL	69.239	JP Morgan	5/9/2023	(51)
USD	70.000	NOK	747.938	Goldman Sachs	18/9/2023	(267)
USD	56.000	ZAR	1.038.595	Citigroup	18/9/2023	795
USD	28.000	CAD	37.921	JP Morgan	18/9/2023	(36)
USD	56.000	CLP	48.216.000	Toronto-Dominion	15/9/2023	(357)
USD	1.397.868	MXN	23.631.381	Barclays	28/9/2023	(8.308)
USD	111.000	MXN	1.873.114	Goldman Sachs	18/9/2023	(653)
USD	56.000	BRL	273.672	Citigroup	5/9/2023	462

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	42.000	ZAR	782.877	UBS	18/9/2023	387
USD	14.000	ZAR	260.477	HSBC Bank	18/9/2023	155
USD	28.000	ZAR	522.408	JP Morgan	18/9/2023	232
USD	78.000	BRL	381.284	HSBC Bank	5/9/2023	624
USD	28.185	EUR	26.000	Goldman Sachs	18/9/2023	(43)
USD	25.058	EUR	23.000	Morgan Stanley	18/9/2023	88
USD	84.000	CNH	612.670	Citigroup	18/9/2023	(272)
USD	17.484	EUR	16.000	Barclays	18/9/2023	113
USD	14.000	NOK	147.650	Morgan Stanley	18/9/2023	129
ZAR	1.003.300	EUR	48.000	Morgan Stanley	18/9/2023	1.216
ZAR	364.026	USD	19.000	Morgan Stanley	18/9/2023	350
ZAR	3.199.553	USD	166.477	Morgan Stanley	7/11/2023	2.822
ZAR	268.089	USD	14.000	State Street	18/9/2023	250
ZAR	266.479	USD	14.000	Barclays	18/9/2023	164
ZAR	523.594	USD	28.000	BNP Paribas	18/9/2023	(169)
ZAR	1.047.794	USD	56.000	Bank of America	18/9/2023	(306)
ZAR	1.578.556	USD	84.000	UBS	18/9/2023	(93)
ZAR	786.134	USD	42.000	JP Morgan	18/9/2023	(214)
Moins-value nette non réalisée						(50.273)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	26.703.752	USD	29.298.984	BNY Mellon	15/9/2023	(311.277)
USD	496.270	EUR	454.255	BNY Mellon	15/9/2023	3.166
Moins-value nette non réalisée						(308.111)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	70.013	USD	89.083	BNY Mellon	15/9/2023	(326)
USD	1.838	GBP	1.444	BNY Mellon	15/9/2023	6
Moins-value nette non réalisée						(320)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 67.482.101)						(358.704)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
4	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	577.191	1.237
(6)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	6.032.638	23.911
19	AUD	Australian 10 Year Bond	Septembre 2023	1.431.970	(7.690)
(57)	AUD	Australian 3 Year Bond	Septembre 2023	3.929.072	(14.562)
(3)	GBP	3 Month SONIA	Septembre 2023	902.345	2.313
(6)	EUR	Euro BUXL	Décembre 2023	868.520	(6.748)
1	USD	3 Month SOFR	Décembre 2023	236.450	(188)
32	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	3.890.000	25.511
(113)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	12.530.641	(93.288)
1	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	115.984	1.234
(6)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	776.812	(4.688)
(35)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	7.128.516	(8.867)
297	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	31.720.992	135.731
4	EUR	3 Month EURIBOR	Juin 2024	1.045.833	(4.652)
399	USD	3 Month SOFR	Juin 2024	94.528.087	(182.793)
60	USD	3 Month SOFR	Septembre 2024	14.259.750	(6.749)
3	GBP	3 Month SONIA	Septembre 2024	897.211	3.233
(2)	CAD	Banker's Acceptance	Septembre 2024	350.628	(277)
7	USD	3 Month SOFR	Décembre 2024	1.670.025	(3.373)
(4)	USD	3 Month SOFR	Mars 2025	957.800	3.626
Total				183.850.465	(137.079)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 109.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(1.488)	(766)
CDS	USD 110.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(1.503)	(773)
CDS	USD 110.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(1.503)	(773)
CDS	USD 107.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(1.449)	(752)
CDS	USD 150.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(2.030)	(1.054)
CDS	USD 66.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/12/2024	(894)	(464)
CDS	USD 217.500	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(10.567)	9.563
CDS	USD 59.000	Fund receives default protection on Federative Republic Of Brazil; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(2.354)	1.585
CDS	USD 129.902	Fund receives default protection on Mexican; and pays Fixed 1%	Barclays	20/6/2028	(2.353)	(59)
CDS	USD 278.100	Fund receives default protection on American Electric Power; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(807)	(7.230)
CDS	USD 139.050	Fund receives default protection on American Electric Power; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(417)	(3.615)
CDS	USD 182.850	Fund receives default protection on American Electric Power; and pays Fixed 1%	BNP Paribas	20/6/2028	(588)	(4.754)
CDS	USD 393.000	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	(1.234)	(11.628)
CDS	EUR 346.850	Fund receives default protection on ITRAXX.XO.39.V1; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	(628)	(15.543)
CDS	USD (160.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.10.A; and receives Fixed 2%	Deutsche Bank	17/11/2059	(6.945)	(14.294)
CDS	USD (80.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.10.A; and receives Fixed 2%	Deutsche Bank	17/11/2059	(3.411)	(7.147)
CDS	USD 184.540	Fund receives default protection on American Express; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(47)	(4.385)
CDS	USD 123.026	Fund receives default protection on American Express; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(40)	(2.923)
CDS	USD 172.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Goldman Sachs	20/6/2028	(1.675)	7.562
CDS	USD (60.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.BBB-14; and receives Fixed 3%	Goldman Sachs	16/12/2072	(4.563)	(14.703)
CDS	USD 78.000	Fund receives default protection on Colombia Government International Bond; and pays Fixed 1%	Morgan Stanley	20/6/2028	(988)	3.430
CDS	USD (7.000)	Fund provides default protection on CMBX.NA.9.BBB-; and receives Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	(1.492)	(1.486)
CDS	USD 4.968	Fund receives default protection on CMBX.NA.9.AAA; and pays Fixed 0,5%	Morgan Stanley	17/9/2058	(44)	15
CDS	USD 7.000	Fund receives default protection on CMBX.NA.9.BBB; and pays Fixed 3%	Morgan Stanley	17/9/2058	1.125	1.486
IFS	EUR 204.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,808%	Bank of America	15/8/2053	4.988	4.988
IFS	EUR 204.000	Fund provides default protection CPTFEMU + 0bps; and receives Fixed 2,82%	Bank of America	15/8/2053	4.676	5.804
IRS	BRL 1.242.000	Fund receives Fixed 9,98%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	HSBC Bank	2/1/2026	(625)	(625)
IRS	COP 670.756.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 11,895%	Bank of America	19/10/2024	(507)	(507)
IRS	BRL 979.422	Fund receives Fixed 11,865%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	2/1/2025	2.362	2.362
IRS	JPY 86.933.128	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,2%	Bank of America	3/2/2025	(1.185)	(1.185)
IRS	JPY 86.933.128	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,205%	Bank of America	3/2/2025	(1.227)	(1.227)
IRS	ZAR 7.457.000	Fund receives Fixed 7,2%; and pays Floating ZAR JIBAR 3 Month	Bank of America	20/3/2025	(2.403)	(2.403)
IRS	CZK 17.050.000	Fund receives Floating CZK-PRIBOR-PRBO 3 Month; and pays Fixed 4,615%	Bank of America	19/6/2025	(2.956)	(2.956)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	USD 6.047.000	Fund receives Fixed 4,185%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	29/7/2025	(6.817)	(6.818)
IRS	EUR 5.350.500	Fund receives Floating EUR ESTR 1 Day; and pays Fixed 3,225%	Bank of America	29/7/2025	(6.088)	(6.088)
IRS	USD 25.597.440	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 4,7915%	Bank of America	4/8/2025	26.370	26.370
IRS	USD 5.654.000	Fund receives Fixed 4,053%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	16/8/2025	(81.179)	(81.179)
IRS	USD 2.718.000	Fund receives Fixed 4,1115%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	24/8/2025	(35.925)	(35.925)
IRS	USD 2.827.000	Fund receives Fixed 4,1527%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	24/8/2025	(35.188)	(35.188)
IRS	USD 2.718.000	Fund receives Fixed 4,1005%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	25/8/2025	(36.468)	(36.468)
IRS	USD 2.827.000	Fund receives Fixed 4,1327%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	25/8/2025	(36.228)	(36.228)
IRS	USD 5.436.000	Fund receives Fixed 4,181%; and pays Floating USD SOFR 1 Day	Bank of America	28/8/2025	(64.583)	(64.583)
IRS	CAD 2.674.000	Fund receives Fixed 4,3815%; and pays Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day	Bank of America	20/7/2026	(8.987)	(8.987)
IRS	CAD 2.674.000	Fund receives Fixed 4,396%; and pays Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day	Bank of America	20/7/2026	(8.190)	(8.190)
IRS	KRW 367.232.375	Fund receives Fixed 3,1875%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(3.631)	(3.631)
IRS	KRW 271.432.625	Fund receives Fixed 3,19%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(2.670)	(2.670)
IRS	KRW 146.827.649	Fund receives Fixed 3,33%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(1.005)	(1.005)
IRS	KRW 146.849.675	Fund receives Fixed 3,38%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(848)	(848)
IRS	KRW 146.849.676	Fund receives Fixed 3,3825%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(840)	(840)
IRS	KRW 197.100.000	Fund receives Fixed 3,545%; and pays Floating KRW KORIBOR 3 Month	Bank of America	20/9/2026	(443)	(443)
IRS	BRL 523.000	Fund receives Fixed 10,04%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Bank of America	4/1/2027	(1.005)	(1.005)
IRS	BRL 237.000	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 10,1%	Bank of America	4/1/2027	174	174
IRS	MXN 3.069.000	Fund receives Fixed 8,42%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	20/1/2028	(4.018)	(4.018)
IRS	MXN 1.789.000	Fund receives Fixed 8,35%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	28/4/2028	(2.531)	(2.531)
IRS	EUR 186.000	Fund receives Fixed 3,1518%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	21/7/2028	(66)	(66)
IRS	CZK 3.945.000	Fund receives Fixed 4,321%; and pays Floating CZK-PRIBOR-PRBO 6 Month	Bank of America	20/9/2028	706	706
IRS	PLN 513.000	Fund receives Floating PLN WIBOR 6 Month; and pays Fixed 5,7005%	Bank of America	20/9/2028	(6.509)	(6.509)
IRS	EUR 274.000	Fund receives Fixed 2,4425%; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month	Bank of America	14/7/2032	(5.219)	(5.219)
IRS	JPY 51.356.100	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,885%	Bank of America	15/2/2033	(3.397)	(3.397)
IRS	JPY 51.356.100	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,8975%	Bank of America	15/2/2033	(3.802)	(3.802)
IRS	JPY 102.712.200	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,9%	Bank of America	15/2/2033	(7.765)	(7.765)
IRS	JPY 148.755.600	Fund receives Floating JPY TONAR 1 Day; and pays Fixed 0,9175%	Bank of America	15/2/2033	(12.884)	(12.884)
IRS	CAD 40.201	Fund receives Fixed 3,3%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	27/3/2033	(2.094)	(2.091)
IRS	CAD 40.864	Fund receives Fixed 3,35%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	30/3/2033	(1.911)	(1.997)
IRS	CAD 120.865	Fund receives Fixed 3,28%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	25/4/2033	(5.934)	(6.337)
IRS	CAD 40.969	Fund receives Fixed 3,442%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	9/5/2033	(1.717)	(1.717)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	CAD 41.620	Fund receives Fixed 3,3625%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	12/5/2033	(1.940)	(1.942)
IRS	CAD 124.712	Fund receives Fixed 3,43%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	15/5/2033	(4.682)	(5.293)
IRS	CAD 42.470	Fund receives Fixed 3,77%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	30/5/2033	(880)	(900)
IRS	CAD 42.948	Fund receives Fixed 3,6829%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	31/5/2033	(1.138)	(1.138)
IRS	CAD 43.470	Fund receives Fixed 3,677%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	1/6/2033	(1.166)	(1.166)
IRS	CAD 7.915	Fund receives Fixed 3,921%; and pays Floating CAD CDOR 3 Month	Bank of America	13/6/2033	(94)	(94)
IRS	CAD 1.717.266	Fund receives Fixed 3,54%; and pays Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day	Bank of America	15/6/2033	(25.678)	(25.678)
IRS	CAD 874.889	Fund receives Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day; and pays Fixed 3,5675%	Bank of America	20/7/2033	10.812	10.812
IRS	CAD 875.000	Fund receives Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day; and pays Fixed 3,569%	Bank of America	20/7/2033	10.734	10.734
IRS	MXN 744.000	Fund receives Fixed 8,5%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	Bank of America	28/7/2033	(790)	(790)
IRS	EUR 160.000	Fund receives Fixed 2,85708%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	28/8/2033	445	410
IRS	CAD 17.420	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,37%	Bank of America	27/3/2053	1.204	1.201
IRS	CAD 17.707	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,4%	Bank of America	30/3/2053	1.102	1.147
IRS	CAD 52.375	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,32%	Bank of America	25/4/2053	3.585	3.906
IRS	CAD 17.753	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,4841%	Bank of America	9/5/2053	917	917
IRS	CAD 18.035	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,375%	Bank of America	12/5/2053	1.209	1.194
IRS	CAD 54.042	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,44%	Bank of America	15/5/2053	2.858	3.098
IRS	CAD 18.404	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,66%	Bank of America	30/5/2053	444	498
IRS	CAD 18.611	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,5816%	Bank of America	31/5/2053	700	700
IRS	CAD 18.900	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,5595%	Bank of America	1/6/2053	766	766
IRS	CAD 3.430	Fund receives Floating CAD CDOR 3 Month; and pays Fixed 3,7685%	Bank of America	13/6/2053	42	42
IRS	CAD 764.000	Fund receives Floating CAD-CORRA-OIS-COMPOUND 1 Day; and pays Fixed 3,404%	Bank of America	15/6/2053	13.319	13.318
IRS	USD 68.132	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 2,8417%	Bank of America	25/8/2053	(131)	(131)
IRS	GBP 800.000	Fund receives Fixed 5,65%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	Bank of America	22/8/2025	3.528	3.528
IRS	GBP 1.170.000	Fund receives Fixed 5,4%; and pays Floating GBP SONIA 1 Day	BNP Paribas	23/8/2025	1.921	1.874
IRS	GBP 1.250.000	Fund receives Floating GBP SONIA 1 Day; and pays Fixed 4,75%	Bank of America	26/8/2026	(2.180)	(2.034)
IRS	MXN 370.000	Fund receives Fixed 8,58%; and pays Floating MXN MXIBTIE 1 Month	BNP Paribas	1/8/2033	(276)	(276)
IRS	EUR 640.000	Fund receives Fixed 3,0313%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	23/8/2033	6.578	6.578
IRS	USD 750.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,8642%	Bank of America	23/8/2033	(8.613)	(8.613)
IRS	EUR 430.000	Fund receives Fixed 2,87515%; and pays Floating EUR ESTR 1 Day	Bank of America	25/8/2033	1.510	1.461
IRS	USD 500.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,71334%	Bank of America	25/8/2033	(3.297)	(2.914)
IRS	USD 180.000	Fund receives Floating USD SOFR 1 Day; and pays Fixed 3,828%	Bank of America	26/8/2035	(3.594)	(3.561)
IRS	BRL 5.460.565	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 12,615%	Citibank	2/1/2024	(186)	(186)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
IRS	COP 1.293.455.000	Fund receives Floating COP-IBR-BANREP 1 Day; and pays Fixed 12,37%	Citibank	18/4/2024	249	249
IRS	BRL 932.000	Fund receives Fixed 11,745%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	5.821	5.821
IRS	BRL 968.552	Fund receives Fixed 11,8%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Citibank	2/1/2026	6.347	6.347
IRS	BRL 1.257.000	Fund receives Fixed 10,1075%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	2/1/2026	10	10
IRS	BRL 591.352	Fund receives Fixed 10,005%; and pays Floating BRL BROIS 1 Day	Goldman Sachs	4/1/2027	(1.221)	(1.221)
IRS	BRL 108.000	Fund receives Floating BRL BROIS 1 Day; and pays Fixed 10,105%	Goldman Sachs	4/1/2027	86	86
TRS	USD 2.813.000	Fund receives USD SOFR 1D Overnight + 0bps; and pays iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	(63.428)	(48.740)
TRS	USD 1.406.500	Fund receives USD SOFR 1D Overnight + 0bps; and pays iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bps	Goldman Sachs	20/9/2023	(27.812)	(18.113)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 90.847.266)					(476.383)	(473.729)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

IFS : Swaps liés à l'inflation (Inflation Swaps)

IRS : Swaps sur taux d'intérêt (Interest Rate Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
20.000	Put	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1,018	12/9/2023	(843)	-
114.000	Put	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 4,65	27/9/2023	(279)	27
104.000	Put	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,4	6/10/2023	64	2.187
940.000	Call	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 150	1/5/2024	1.726	7.197
144.000	Put	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7,1	28/9/2023	(1.121)	66
114.000	Put	OTC USD/MXN	Barclays	USD 17,2	6/10/2023	1.471	3.138
104.000	Put	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,08	16/10/2023	111	786
14.000	Put	OTC CNH/USD	Citibank	USD 7,22	26/1/2024	650	2.372
102.000	Call	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,105	11/9/2023	(1.014)	41
12.000	Put	OTC PLN/EUR	HSBC Bank	EUR 4,66	1/11/2023	1.327	2.850
9.000	Put	OTC EUR/USD	HSBC Bank	EUR 1,05	16/11/2023	(4)	1.189
225	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 94,875	13/10/2023	133.115	184.219
337	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95	13/10/2023	281.217	374.912
562	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,625	13/10/2023	890.940	1.482.275
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 239.209.023)						1.307.360	2.061.259

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(104.000)	Call	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,7	6/10/2023	798	(285)
(104.000)	Put	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5,2	6/10/2023	129	(514)
(196.000)	Put	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7,27	6/10/2023	96	(1.343)
(144.000)	Call	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7,25	28/9/2023	(473)	(945)
(144.000)	Put	OTC USD/CNH	Barclays	USD 6,95	28/9/2023	317	(1)
(86.000)	Call	OTC USD/MXN	Barclays	USD 18,3	6/10/2023	554	(48)
(114.000)	Put	OTC USD/MXN	Barclays	USD 16,7	6/10/2023	(403)	(933)
(104.000)	Call	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1,115	16/10/2023	240	(207)
(154.000)	Call	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1,12	11/9/2023	722	(3)
(4)	Put	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 106,5	22/9/2023	1.525	(1.531)
(225)	Put	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 95,125	13/10/2023	(217.042)	(317.813)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Options vendues au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
(337)	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,25	13/10/2023	(406.618)	(577.112)
(562)	Put	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95,375	13/10/2023	(756.460)	(1.134.537)
(1)	Put	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 109	27/10/2023	592	(500)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 245.846.566)						(1.376.023)	(2.035.772)

Swaptions achetées au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD		
USD 114.789.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,5% Fixed semi-annually from 24/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 24/1/2025	Citibank	22/1/2024	(143.807)	141.444		
USD 114.789.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,55% Fixed semi-annually from 26/7/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 26/1/2025	Citibank	24/1/2024	(117.383)	158.684		
EUR 4.070.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 9/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024	JP Morgan	7/8/2024	(1.115)	12.305		
EUR 4.040.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3% Fixed annually from 29/8/2025; and pays Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024	JP Morgan	27/8/2024	(1.189)	13.219		
USD 233.400	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,235% Fixed semi-annually from 17/12/2026; and pays Floating USD SOFR annually from 17/6/2027	Barclays	15/6/2026	(2.663)	8.547		
USD 233.400	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 17/6/2027; and pays 3,235% Fixed semi-annually from 17/12/2026	Barclays	15/6/2026	3.645	14.854		
USD 326.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 22/7/2027; and pays 3,211% Fixed semi-annually from 22/1/2027	Barclays	20/7/2026	5.189	21.220		
USD 326.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,211% Fixed semi-annually from 22/1/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 22/7/2027	Barclays	20/7/2026	(4.206)	11.825		
USD 626.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 22/7/2027; and pays 3,225% Fixed semi-annually from 22/1/2027	Barclays	20/7/2026	9.628	40.388		
USD 626.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,225% Fixed semi-annually from 22/1/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 22/7/2027	Barclays	20/7/2026	(7.768)	22.992		
USD 580.000	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,582% Fixed semi-annually from 5/2/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 5/8/2027	Barclays	3/8/2026	(1.045)	28.912		
USD 580.000	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 5/8/2027; and pays 3,582% Fixed semi-annually from 5/2/2027	Barclays	3/8/2026	(141)	29.816		
USD 2.093.875	Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 13/8/2027; and pays 3,63% Fixed semi-annually from 13/2/2027	Barclays	11/8/2026	(4.948)	104.562		
USD 2.093.875	Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,63% Fixed semi-annually from 13/2/2027; and pays Floating USD SOFR annually from 13/8/2027	Barclays	11/8/2026	(883)	108.627		
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 78.131.567)						(266.686)	717.395

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (5.437.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,39% Fixed semi-annually from 7/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 7/9/2024	JP Morgan	5/9/2023	(28.116)	(42.959)
USD (5.436.000)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 4,605% Fixed semi-annually from 7/3/2024; and pays Floating USD SOFR annually from 7/9/2024	Barclays	5/9/2023	(5.869)	(21.497)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Bond Fund suite

Swaptions vendues au 31 août 2023

Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
USD (114.789.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 24/1/2025; and pays 3,8% Fixed semi-annually from 24/7/2024	Citibank	22/1/2024	73.473	(47.055)
USD (114.789.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 26/1/2025; and pays 3,85% Fixed semi-annually from 26/7/2024	Citibank	24/1/2024	54.467	(53.434)
EUR (4.070.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 9/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 9/8/2024	JP Morgan	7/8/2024	508	(4.011)
EUR (4.040.000)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR semi-annually from 29/11/2024; and pays 2% Fixed annually from 29/8/2025	JP Morgan	27/8/2024	(448)	(4.465)
USD (1.242.174)	Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD SOFR annually from 3/9/2026; and pays 3,585% Fixed semi-annually from 3/3/2026	Bank of America	29/8/2025	321	(55.685)
USD (1.242.174)	Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 3,585% Fixed semi-annually from 3/3/2026; and pays Floating USD SOFR annually from 3/9/2026	Bank of America	29/8/2025	66	(55.941)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 41.282.756)				94.402	(285.047)

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 315.028	Fannie Mae or Freddie Mac 1,5% TBA	268.910	0,05
USD 1.610.851	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	1.413.039	0,26
USD 12.655.345	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	10.906.353	1,97
USD 10.853.031	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	9.696.164	1,75
USD 15.713.473	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	15.239.896	2,75
USD 4.559.100	Ginnie Mae 2% TBA	3.771.943	0,68
USD 3.677.156	Ginnie Mae 2,5% TBA	3.135.164	0,57
USD 2.345.005	Ginnie Mae 3% TBA	2.063.424	0,37
USD 2.048.500	Ginnie Mae 4% TBA	1.907.114	0,34
USD 1.694.000	Ginnie Mae 4,5% TBA	1.614.466	0,29
USD 1.869.000	Ginnie Mae 5% TBA	1.820.483	0,33
USD 6.012.308	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	4.793.876	0,87
USD 993.181	Ginnie Mae 3,5% TBA	902.212	0,16
USD (47.800)	Fannie Mae or Freddie Mac 1,5% TBA	(36.119)	(0,01)
USD (583.500)	Fannie Mae or Freddie Mac 2,5% TBA	(525.188)	(0,09)

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
USD (2.841.900)	Fannie Mae or Freddie Mac 2,5% TBA	(2.357.301)	(0,43)
USD (371.000)	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	(342.646)	(0,06)
USD (65.000)	Fannie Mae or Freddie Mac 3,5% TBA	(61.257)	(0,01)
USD 233.000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	223.539	0,04
USD (6.891.400)	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	(6.360.844)	(1,15)
USD 294.000	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	286.154	0,05
USD (6.448.000)	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	(6.115.041)	(1,10)
USD 24.442.834	Fannie Mae or Freddie Mac 5,5% TBA	24.147.016	4,36
USD (2.524.100)	Fannie Mae or Freddie Mac 6% TBA	(2.530.048)	(0,46)
USD 1.598.000	Fannie Mae or Freddie Mac 6,5% TBA	1.622.740	0,29
USD 1.281.000	Ginnie Mae 5,5% TBA	1.268.699	0,23
USD 687.000	Ginnie Mae 6% TBA	689.048	0,12
USD 330.000	Ginnie Mae 6,5% TBA	334.490	0,06
Total TBA (USD Exposition sous-jacente - USD 104.433.174)		67.776.286	12,23

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 635.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 5,75% 15/4/2025	631.077	0,03
COMPARTIMENTS				USD 1.760.000	Air Canada 3,875% 15/8/2026	1.627.910	0,08
Irlande				USD 849.000	ATS 4,125% 15/12/2028	755.511	0,04
206.000	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF ⁻	18.793.380	1,00	USD 840.000	Baytex Energy 8,5% 30/4/2030	852.334	0,05
Total des Compartiments				USD 5.483.000	Bombardier 6% 15/2/2028	5.125.480	0,27
ACTIONS ORDINAIRES				USD 6.817.000	Bombardier 7,125% 15/6/2026	6.708.319	0,36
France				USD 856.000	Bombardier 7,45% 1/5/2034	974.984	0,05
260.348	Constellium*	4.621.177	0,25	USD 154.000	Bombardier 7,5% 15/3/2025	154.140	0,01
Luxembourg				USD 2.779.000	Bombardier 7,5% 1/2/2029	2.730.849	0,14
12.532	ADLER	6.948	0,00	USD 2.664.000	Bombardier 7,875% 15/4/2027	2.660.230	0,14
Panama				USD 2.211.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 4,875% 15/2/2030	1.823.427	0,10
69.155	Carnival*	1.093.341	0,06	USD 1.580.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	1.318.122	0,07
États-Unis				USD 1.798.000	Enerflex 9% 15/10/2027	1.789.026	0,09
7.658	Block	444.164	0,02	USD 1.681.000	ERO Copper 6,5% 15/2/2030	1.469.388	0,08
21.553	Catalent*	1.077.435	0,06	USD 1.962.000	First Quantum Minerals 8,625% 1/6/2031	1.998.850	0,11
70.139	Element Solutions*	1.458.891	0,08	USD 1.721.000	Garda World Security 4,625% 15/2/2027	1.593.646	0,08
89.638	Informatica*	1.873.434	0,10	USD 3.321.000	Garda World Security 7,75% 15/2/2028	3.316.052	0,18
2.730	Nine Energy Service	12.312	0,00	USD 402.000	Garda World Security 9,5% 1/11/2027	388.986	0,02
3.677	Twilio*	232.497	0,01	USD 518.000	GFL Environmental 3,5% 1/9/2028	458.597	0,02
28.994	Uber Technologies	1.356.339	0,07	USD 1.978.000	GFL Environmental 3,75% 1/8/2025	1.886.602	0,10
Total des actions ordinaires				USD 1.553.000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	1.393.677	0,07
		6.455.072	0,34	USD 752.000	GFL Environmental 4,25% 1/6/2025	728.235	0,04
OBLIGATIONS				USD 1.232.000	GFL Environmental 4,375% 15/8/2029	1.096.145	0,06
Australie				USD 1.780.000	GFL Environmental 4,75% 15/6/2029	1.632.370	0,09
USD 715.000	Macquarie Bank 6,798% 18/1/2033	723.651	0,04	USD 1.575.000	GFL Environmental 5,125% 15/12/2026	1.525.687	0,08
Bermudes				USD 2.709.000	Husky III 13% 15/2/2025*	2.702.227	0,14
USD 781.000	Aircastle 6,5% 18/7/2028	775.015	0,04	USD 3.109.000	Jones Deslauriers Insurance Management 8,5% 15/3/2030	3.176.590	0,17
USD 13.929.000	Carnival Bermuda 10,375% 1/5/2028	15.175.714	0,81	USD 1.620.000	Jones Deslauriers Insurance Management 10,5% 15/12/2030	1.650.774	0,08
USD 50.785	Digicel 8,75% 25/5/2024	46.518	0,00	USD 1.245.000	Masonite International 3,5% 15/2/2030	1.043.796	0,06
USD 1.051.000	Nabors Industries 7,25% 15/1/2026	1.012.562	0,05	USD 1.343.000	Mattamy 4,625% 1/3/2030	1.185.829	0,06
USD 1.954.000	Nabors Industries 7,5% 15/1/2028	1.800.125	0,10	USD 956.000	Mattamy 5,25% 15/12/2027	899.966	0,05
USD 2.084.000	NCL 5,875% 15/3/2026	1.966.035	0,10	USD 4.829.000	New Gold 7,5% 15/7/2027	4.611.560	0,24
USD 388.000	NCL 7,75% 15/2/2029	370.540	0,02	USD 1.692.000	NOVA Chemicals 4,875% 1/6/2024	1.664.218	0,09
USD 863.000	NCL 8,375% 1/2/2028	889.737	0,05	USD 5.392.000	Open Text 6,9% 1/12/2027	5.473.716	0,29
USD 1.328.000	NCL Finance 6,125% 15/3/2028	1.191.601	0,06	USD 403.000	Precision Drilling 6,875% 15/1/2029*	383.492	0,02
USD 1.160.000	Seadrill Finance 8,375% 1/8/2030	1.189.719	0,06	USD 658.000	Tervita 11% 1/12/2025	688.227	0,04
USD 213.000	Seadrill Finance 8,375% 1/8/2030	218.457	0,01	USD 7.488.000	Titan Acquisition / Titan Co-Borrower 7,75% 15/4/2026	7.275.662	0,39
USD 4.273.000	Valaris 8,375% 30/4/2030	4.360.169	0,23	USD 706.000	TransAlta 7,75% 15/11/2029	727.338	0,04
USD 1.239.000	Weatherford International 6,5% 15/9/2028*	1.242.176	0,06	USD 1.315.000	Vermilion Energy 6,875% 1/5/2030*	1.253.438	0,07
USD 2.965.000	Weatherford International 8,625% 30/4/2030	3.041.470	0,16	Îles Caïmans			
Total des obligations						79.327.742	4,21
		33.279.838	1,75	USD 264.000	GGAM Finance 7,75% 15/5/2026	265.362	0,01
Îles Vierges britanniques				USD 264.000	GGAM Finance 8% 15/6/2028	267.827	0,02
EUR 166.000	Global Switch 2,25% 31/5/2027	167.651	0,01	Total des titres			
Canada							
USD 796.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,875% 15/1/2028	725.046	0,04	Total des titres			
USD 815.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	694.151	0,04				
USD 579.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4,375% 15/1/2028	532.068	0,03				

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.975.615	Global Aircraft Leasing 6,5% 15/9/2024	1.854.319	0,10	GBP 300.000	Clariane 4,125% 15/3/2024	294.177	0,01
USD 1.650.174	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5,75% 20/1/2026*	1.527.824	0,08	USD 3.585.000	Constellium 3,75% 15/4/2029	3.081.556	0,16
USD 772.000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10,875% 15/1/2031	776.671	0,04	EUR 1.017.000	Constellium 4,25% 15/2/2026*	1.084.830	0,06
USD 1.200.000	Melco Resorts Finance 4,875% 6/6/2025	1.139.622	0,06	USD 1.639.000	Constellium 5,625% 15/6/2028	1.550.782	0,08
USD 3.200.000	Melco Resorts Finance 5,375% 4/12/2029	2.680.032	0,14	USD 2.226.000	Constellium 5,875% 15/2/2026	2.193.966	0,12
USD 400.000	Melco Resorts Finance 5,75% 21/7/2028*	354.842	0,02	USD 2.075.000	Credit Agricole 4,75% 23/3/2029*	1.628.507	0,09
USD 529.000	MGM China 4,75% 1/2/2027*	478.263	0,03	EUR 111.000	Crown European 3,375% 15/5/2025	118.282	0,01
USD 200.000	MGM China 5,25% 18/6/2025	192.417	0,01	EUR 100.000	Crown European 5% 15/5/2028*	109.215	0,01
USD 400.000	MGM China 5,875% 15/5/2026*	382.954	0,02	EUR 200.000	Electricite de France 3% 3/9/2027	185.743	0,01
USD 800.000	Sable International Finance 5,75% 7/9/2027	744.936	0,04	EUR 600.000	Electricite de France 3,375% 15/6/2030	507.103	0,03
USD 2.119.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	2.226.535	0,12	EUR 200.000	Electricite de France 4% 4/7/2024	211.076	0,01
USD 2.686.000	Seagate HDD Cayman 8,5% 15/7/2031	2.815.750	0,15	USD 577.000	Electricite de France 9,125% 15/3/2033	602.504	0,03
USD 355.069	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	355.459	0,02	EUR 200.000	Elior 3,75% 15/7/2026	172.888	0,01
USD 1.139.000	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	1.142.489	0,06	EUR 300.000	Eutelsat 1,5% 13/10/2028*	248.681	0,01
USD 3.213.000	Transocean 7,5% 15/1/2026	3.161.103	0,17	EUR 200.000	Forvia 2,75% 15/2/2027	198.111	0,01
USD 1.469.000	Transocean 8% 1/2/2027	1.430.064	0,08	EUR 210.000	Forvia 7,25% 15/6/2026	237.184	0,01
USD 6.009.700	Transocean 8,75% 15/2/2030	6.175.856	0,33	EUR 172.000	Goldstory 5,375% 1/3/2026*	180.410	0,01
USD 2.323.000	Transocean 11,5% 30/1/2027	2.448.407	0,13	EUR 100.000	iliad 1,875% 11/2/2028	93.212	0,00
USD 1.130.000	Transocean Titan Financing 8,375% 1/2/2028	1.162.489	0,06	EUR 200.000	iliad 5,375% 14/6/2027	215.368	0,01
USD 644.000	Wynn Macau 5,5% 15/1/2026	604.462	0,03	EUR 100.000	iliad 5,625% 15/2/2030	105.674	0,01
USD 3.899.000	Wynn Macau 5,625% 26/8/2028*	3.425.096	0,18	USD 6.107.000	Iliad 6,5% 15/10/2026	5.824.065	0,31
		35.612.779	1,90	USD 1.099.000	Iliad 7% 15/10/2028	1.023.892	0,05
				EUR 200.000	La Financiere Atalian 5,125% 15/5/2025	149.076	0,01
	Chypre			EUR 100.000	Loxam 5,75% 15/7/2027*	100.824	0,00
EUR 100.000	Bank of Cyprus 2,5% 24/6/2027	96.799	0,01	EUR 115.000	Loxam 6,375% 15/5/2028	123.906	0,01
	Finlande			EUR 100.000	Novafives 5% 15/6/2025	102.580	0,00
EUR 100.000	Ahlstrom 3 Oy 3,625% 4/2/2028	90.956	0,00	EUR 172.000	Paprec 3,5% 1/7/2028	170.945	0,01
USD 200.000	Ahlstrom 3 Oy 4,875% 4/2/2028	166.850	0,01	EUR 168.000	Picard Groupe 3,875% 1/7/2026	168.356	0,01
EUR 224.000	SBB Treasury 0,75% 14/12/2028	136.350	0,01	EUR 900.000	RCI Banque 2,625% 18/2/2030	919.084	0,05
EUR 100.000	SBB Treasury 1,125% 26/11/2029	60.231	0,00	USD 247.000	Societe Generale 7,875% 18/12/2023	246.355	0,01
		454.387	0,02	EUR 100.000	Societe Generale 7,875% 18/1/2029	106.052	0,01
	France			EUR 150.000	Tereos Finance Groupe I 7,25% 15/4/2028	168.951	0,01
EUR 200.000	Accor 4,375% 31/1/2024	214.673	0,01	EUR 200.000	Vallourec 8,5% 30/6/2026	216.965	0,01
EUR 100.000	Air France-KLM 1,875% 16/1/2025*	103.267	0,00			31.725.551	1,68
EUR 100.000	Air France-KLM 8,125% 31/5/2028	113.158	0,01		Allemagne		
EUR 200.000	Altice France 2,125% 15/2/2025	201.257	0,01	EUR 400.000	Bayer 4,5% 25/3/2082	412.708	0,02
EUR 100.000	Altice France 2,5% 15/1/2025	100.616	0,01	EUR 132.000	Cheplapharm Arzneimittel 7,5% 15/5/2030	144.804	0,01
USD 1.095.000	Altice France 5,125% 15/1/2029	785.149	0,04	EUR 400.000	Commerzbank 6,125% 9/10/2025	394.161	0,02
USD 1.338.000	Altice France 5,125% 15/7/2029	951.724	0,05	EUR 200.000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1,875% 15/10/2024	136.900	0,01
USD 4.754.000	Altice France 5,5% 15/10/2029	3.433.947	0,18	EUR 200.000	Deutsche Lufthansa 3,5% 14/7/2029	197.320	0,01
EUR 112.000	Altice France 5,875% 1/2/2027	98.494	0,01	EUR 147.000	Gruenthal 4,125% 15/5/2028	149.261	0,01
USD 3.332.000	Altice France 8,125% 1/2/2027	2.818.980	0,15	EUR 100.000	Gruenthal 6,75% 15/5/2030*	111.695	0,01
EUR 200.000	Atos 0% 6/11/2024	182.960	0,01	EUR 177.000	HT Troplast 9,375% 15/7/2028	192.729	0,01
EUR 100.000	Atos 1,75% 7/5/2025	89.426	0,01	EUR 152.000	IHO Verwaltungs 3,875% 15/5/2027	149.919	0,01
EUR 100.000	Atos 2,5% 7/11/2028	77.303	0,00	EUR 100.000	IHO Verwaltungs 8,75% 15/5/2028	113.327	0,01
EUR 200.000	BNP Paribas 7,375% 11/6/2030	214.277	0,01	EUR 1.700.000	Novelis Sheet Ingot 3,375% 15/4/2029*	1.594.988	0,08
				EUR 229.000	PCF 4,75% 15/4/2026*	193.749	0,01
				EUR 260.000	Renk/Frankfurt am Main 5,75% 15/7/2025	279.979	0,02
				EUR 175.839	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	187.651	0,01
				EUR 250.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	261.605	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 366.000	Tele Columbus 3,875% 2/5/2025*	254.793	0,01	EUR 100.000	Palmer Square European CLO 2023-1 10,05% 15/7/2036	110.384	0,01
EUR 737.100	TK Elevator Holdco 6,625% 15/7/2028	692.040	0,04	GBP 117.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4,875% 15/7/2028	121.961	0,01
USD 4.913.000	TK Elevator Holdco 7,625% 15/7/2028*	4.531.126	0,24	USD 2.094.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV 5% 15/7/2028	1.854.890	0,10
EUR 1.570.000	TK Elevator Midco 4,375% 15/7/2027*	1.555.410	0,08			37.996.355	2,01
EUR 122.000	TUI Cruises 6,5% 15/5/2026	125.629	0,01		Italie		
EUR 300.000	ZF Finance 2% 6/5/2027	289.518	0,01	EUR 411.000	Azzurra Aeroporti 2,125% 30/5/2024	434.539	0,02
EUR 300.000	ZF Finance 2,75% 25/5/2027	296.113	0,01	EUR 125.000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6,75% 2/3/2026	136.265	0,01
EUR 100.000	ZF Finance 5,75% 3/8/2026	109.253	0,01	EUR 150.000	Banco BPM 2,875% 29/6/2031	145.654	0,01
		12.374.678	0,66	EUR 244.000	Banco BPM 4,25% 1/10/2029	261.087	0,01
	Irlande			EUR 250.000	Banco BPM 6% 14/6/2028	273.003	0,02
EUR 328.000	AIB 5,25% 9/10/2024	334.688	0,02	EUR 125.000	Cedacri Mergeco 8,424% 15/5/2028	132.610	0,01
EUR 183.000	Aqueduct European CLO 2-2017 8,063% 15/10/2030	188.751	0,01	EUR 100.000	Cedacri Mergeco 9,281% 15/5/2028	106.874	0,00
EUR 100.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2,125% 15/8/2026	96.883	0,01	EUR 100.000	Enel 6,375% 16/4/2028	110.908	0,01
EUR 1.367.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2,125% 15/8/2026*	1.323.715	0,07	EUR 138.000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11,125% 15/5/2028	149.682	0,01
USD 400.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4,125% 15/8/2026	374.374	0,02	USD 2.816.000	F-Brasile / F-Brasile US 7,375% 15/8/2026*	2.588.202	0,14
GBP 200.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4,75% 15/7/2027	200.186	0,01	EUR 203.000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027*	237.596	0,01
USD 1.799.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5,25% 30/4/2025	1.758.524	0,09	EUR 249.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5,625% 1/8/2027	253.020	0,01
USD 769.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5,25% 15/8/2027	660.867	0,04	EUR 140.000	IMA Industria Macchine Automatiche 3,75% 15/1/2028	135.985	0,01
USD 200.000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5,25% 15/8/2027	171.877	0,01	EUR 347.000	Infrastrutture Wireless Italiane 1,625% 21/10/2028	332.037	0,02
EUR 5.880.000	Aurium CLO II 5,737% 22/6/2034	6.059.532	0,32	EUR 230.000	Inter Media and Communication 6,75% 9/2/2027	241.379	0,01
EUR 5.100.000	Aurium CLO II 6,687% 22/6/2034	5.230.743	0,28	USD 1.585.000	Intesa Sanpaolo 4,198% 1/6/2032*	1.209.628	0,06
EUR 440.000	Avoca CLO XV 7,793% 15/4/2031	424.266	0,02	USD 1.160.000	Intesa Sanpaolo 4,95% 1/6/2042	774.207	0,04
EUR 227.000	Bank of Ireland 7,5% 19/5/2025	241.857	0,01	GBP 150.000	Intesa Sanpaolo 5,148% 10/6/2030	159.638	0,01
EUR 200.000	Bridgepoint CLO I 7,913% 15/1/2034	215.009	0,01	USD 400.000	Intesa Sanpaolo 5,71% 15/1/2026	383.408	0,02
EUR 2.700.000	Contego CLO V 5,463% 15/1/2031	2.821.327	0,15	EUR 202.000	Lottomatica 7,6% 1/6/2028	221.029	0,01
EUR 1.920.000	Contego CLO V 6,313% 15/1/2031	1.982.162	0,10	EUR 113.000	Lottomatica 9,75% 30/9/2027	133.063	0,01
USD 646.000	James Hardie International Finance 5% 15/1/2028*	610.070	0,03	EUR 500.000	Nexi 0% 24/2/2028	424.423	0,02
USD 639.000	Jazz 4,375% 15/1/2029	573.441	0,03	EUR 154.000	Rekeep 7,25% 1/2/2026	155.505	0,01
USD 2.308.000	LCPR Senior Secured Financing 6,75% 15/10/2027	2.176.663	0,11	EUR 146.000	Telecom Italia 1,625% 18/1/2029	124.848	0,01
EUR 2.810.000	Madison Park Euro Funding XI Designated Activity 5,631% 15/2/2031	2.945.554	0,16	EUR 100.000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	104.885	0,01
EUR 6.000.000	Madison Park Euro Funding XI Designated Activity 6,581% 15/2/2031	6.236.890	0,33	USD 985.000	Telecom Italia 5,303% 30/5/2024	973.286	0,05
EUR 100.000	Margay CLO I 10,25% 15/7/2036	110.066	0,00	EUR 200.000	Telecom Italia 6,875% 15/2/2028	219.427	0,01
USD 717.000	Motion Bondco 6,625% 15/11/2027*	666.647	0,03	EUR 412.000	Telecom Italia 7,875% 31/7/2028	465.279	0,02
EUR 298.000	OCP Euro CLO 2017-2 8,663% 15/1/2032	312.075	0,02	EUR 200.000	UniCredit 2,731% 15/1/2032	194.477	0,01
EUR 200.000	OCP Euro CLO 2017-2 10,063% 15/1/2032	192.953	0,01			11.081.944	0,59
					Jamaïque		
				USD 2.078.000	Digicel International Finance/ Digicel international 8,75% 25/5/2024	1.903.417	0,10
					Japon		
				EUR 224.000	SoftBank 2,125% 6/7/2024	235.075	0,01
				EUR 200.000	SoftBank 3,875% 6/7/2032	169.999	0,01
				EUR 100.000	SoftBank 4,5% 20/4/2025	106.540	0,01
				EUR 100.000	SoftBank 4,75% 30/7/2025	106.433	0,00
						618.047	0,03
					Jersey		
				EUR 29.891	Adient Global 3,5% 15/8/2024	31.931	0,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
GBP 200.000	CPUK Finance 4,875% 28/8/2025	242.517	0,01	USD 3.326.000	Herens Holdco 4,75% 15/5/2028	2.558.267	0,14
GBP 205.000	Galaxy Bidco 6,5% 31/7/2026	239.365	0,01	EUR 158.000	Herens Midco 5,25% 15/5/2029	92.398	0,00
		513.813	0,02	USD 2.192.000	ION Trading Technologies 5,75% 15/5/2028*	1.927.551	0,10
	Liberia			EUR 186.000	Kleopatra Finco 4,25% 1/3/2026	168.005	0,01
USD 554.000	Royal Caribbean Cruises 4,25% 1/7/2026	516.991	0,03	EUR 100.000	LHMC Finco 2 7,25% 2/10/2025	108.398	0,00
USD 1.042.000	Royal Caribbean Cruises 5,375% 15/7/2027	979.717	0,05	EUR 100.000	Monitchem HoldCo 3 8,75% 1/5/2028	107.569	0,01
USD 1.200.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 31/8/2026	1.154.101	0,06	EUR 302.000	Rossini 6,75% 30/10/2025	330.520	0,02
USD 1.080.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 1/4/2028	1.015.078	0,05	EUR 278.000	SES 2,875% 27/5/2026	263.053	0,01
USD 1.918.000	Royal Caribbean Cruises 7,25% 15/1/2030	1.948.588	0,10	EUR 100.000	SES 5,625% 29/1/2024	108.570	0,01
USD 1.380.000	Royal Caribbean Cruises 8,25% 15/1/2029	1.443.041	0,08	USD 4.961.000	SK Invictus Intermediate II 5% 30/10/2029*	4.041.610	0,21
USD 2.724.000	Royal Caribbean Cruises 9,25% 15/1/2029	2.903.307	0,15	EUR 100.000	Stena International 7,25% 15/2/2028	112.241	0,01
USD 1.329.000	Royal Caribbean Cruises 11,625% 15/8/2027	1.449.567	0,08	EUR 300.000	Summer BC Holdco B 5,75% 31/10/2026*	295.897	0,02
		11.410.390	0,60	USD 2.347.000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	1.949.502	0,10
	Luxembourg			USD 427.000	Telecom Italia Capital 6,375% 15/11/2033	373.590	0,02
EUR 200.000	Adler Financing 12,5% 30/6/2025	224.078	0,01	USD 412.000	Telecom Italia Capital 7,2% 18/7/2036	370.860	0,02
USD 1.721.000	Albion Financing 1 / Aggreko 6,125% 15/10/2026*	1.624.121	0,08	USD 1.800.000	Telecom Italia Capital 7,721% 4/6/2038	1.657.599	0,09
EUR 150.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3,625% 1/6/2028*	133.644	0,01	EUR 183.000	Telecom Italia Finance 7,75% 24/1/2033*	212.425	0,01
USD 4.631.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	3.917.369	0,21	USD 400.000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5,5% 1/3/2028*	367.600	0,02
USD 4.613.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	3.903.699	0,21			51.187.115	2,72
EUR 140.000	Altice Financing 2,25% 15/1/2025	145.437	0,01		Malte		
EUR 361.000	Altice Financing 4,25% 15/8/2029	299.542	0,02	USD 1.600.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6,375% 1/2/2030	1.312.784	0,07
USD 681.000	Altice Financing 5% 15/1/2028	554.868	0,03	USD 668.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 7,875% 1/5/2027*	605.880	0,03
USD 6.424.000	Altice Financing 5,75% 15/8/2029	5.096.952	0,27			1.918.664	0,10
EUR 2.880.000	Aramark International Finance 3,125% 1/4/2025*	3.047.588	0,16		Îles Marshall		
USD 6.100.795	ARD Finance 6,5% 30/6/2027	4.917.252	0,26	USD 183.000	Danaos 8,5% 1/3/2028	185.358	0,01
EUR 100.000	Aroundtown 3,375% 23/9/2024	45.465	0,00		Maurice		
GBP 281.000	Aroundtown 4,75% 25/6/2024	139.064	0,01	USD 5.103.000	CA Magnum 5,375% 31/10/2026	4.583.719	0,24
USD 1.816.000	Camelot Finance 4,5% 1/11/2026	1.701.785	0,09		Pays-Bas		
GBP 190.000	Cidron Aida Finco 6,25% 1/4/2028	212.841	0,01	EUR 300.000	Abertis Infraestructuras Finance 3,248% 24/11/2025	295.555	0,01
EUR 129.000	Cirsa Finance International 4,75% 22/5/2025	138.507	0,01	EUR 332.000	Axalta Coating Systems Dutch B 3,75% 15/1/2025	356.769	0,02
EUR 100.000	Cirsa Finance International 8,185% 31/7/2028	108.413	0,01	USD 3.698.000	Clear Channel International 6,625% 1/8/2025	3.667.891	0,19
EUR 180.675	Codere Finance 2 Luxembourg 11% 30/9/2026	146.966	0,01	EUR 542.000	Darling Global Finance 3,625% 15/5/2026	577.018	0,03
USD 9.371.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	8.895.085	0,47	USD 2.769.000	Elastic 4,125% 15/7/2029	2.384.444	0,13
EUR 284.000	Cullinan Holdco Scsp 4,625% 15/10/2026*	258.415	0,01	USD 200.000	ING Groep 5,75% 16/11/2026	178.026	0,01
EUR 200.000	Dana Financing Luxembourg 8,5% 15/7/2031	222.540	0,01	EUR 400.000	Naturgy Finance 2,374% 23/11/2026	385.590	0,02
EUR 300.000	European TopSoho 4% 21/9/2021***	250.622	0,01	EUR 126.000	Nobian Finance 3,625% 15/7/2026	121.757	0,01
EUR 187.000	Garfunkelux Holdco 3 6,75% 1/11/2025	157.207	0,01	EUR 680.000	OI European 6,25% 15/5/2028	754.621	0,04
				EUR 130.000	OI European 6,25% 15/5/2028	144.571	0,01
				EUR 118.000	Q-Park I 1,5% 1/3/2025*	123.890	0,01
				EUR 242.000	Repsol International Finance 4,247% 11/9/2028*	238.992	0,01
				USD 858.000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	755.495	0,04
				USD 723.000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	705.445	0,04
				USD 991.000	Sensata Technologies 5,875% 1/9/2030	939.449	0,05
				EUR 292.553	Summer BidCo 9% 15/11/2025	298.112	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 500.000	Telefonica Europe 6,135% 3/2/2030	530.913	0,03	EUR 100.000	EDP - Energias de Portugal 1,7% 20/7/2080	100.276	0,00
EUR 100.000	Telefonica Europe 7,125% 23/8/2028	111.684	0,01	EUR 200.000	EDP - Energias de Portugal 1,875% 2/8/2081	194.205	0,01
EUR 176.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3,75% 9/5/2027	175.032	0,01	EUR 100.000	EDP - Energias de Portugal 5,943% 23/4/2083	107.627	0,01
EUR 295.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,375% 15/9/2029	328.548	0,02			2.151.582	0,11
EUR 100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7,875% 15/9/2031	113.817	0,01		Roumanie		
USD 3.235.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3,15% 1/10/2026	2.929.842	0,15	EUR 200.000	RCS & RDS 2,5% 5/2/2025	208.193	0,01
USD 1.089.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 4,75% 9/5/2027	1.014.796	0,05		Espagne		
USD 200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 6,75% 1/3/2028	199.657	0,01	EUR 200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/3/2024	214.741	0,01
USD 432.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 7,125% 31/1/2025	434.367	0,02	EUR 400.000	Banco de Sabadell 2,5% 15/4/2031	387.914	0,02
USD 1.875.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 7,875% 15/9/2029*	1.957.547	0,10	EUR 100.000	Banco de Sabadell 5,25% 7/2/2029	107.852	0,01
USD 1.218.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 8,125% 15/9/2031	1.292.121	0,07	EUR 100.000	Banco de Sabadell 6% 16/8/2033	102.582	0,01
USD 2.576.000	Trivium Packaging Finance 5,5% 15/8/2026	2.434.635	0,13	USD 1.200.000	Banco Santander 6,921% 8/8/2033*	1.202.296	0,06
EUR 102.000	Trivium Packaging Finance 7,531% 15/8/2026	109.039	0,01	EUR 200.000	Bankinter 7,375% 15/8/2028	207.458	0,01
USD 5.770.000	Trivium Packaging Finance 8,5% 15/8/2027*	5.478.738	0,29	EUR 200.000	CaixaBank 6,75% 13/6/2024	213.915	0,01
EUR 100.000	United 4% 15/11/2027*	93.682	0,00	EUR 100.000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	94.491	0,01
EUR 106.000	UPC 3,875% 15/6/2029	95.818	0,01	EUR 200.000	Cellnex Finance 1,5% 8/6/2028*	188.471	0,01
USD 1.009.000	UPC Broadband Finco 4,875% 15/7/2031	834.039	0,04	EUR 100.000	Cellnex Finance 2% 15/9/2032	85.830	0,00
EUR 170.000	VZ Secured Financing 3,5% 15/1/2032	145.546	0,01	EUR 300.000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	256.321	0,01
EUR 100.000	VZ Vendor Financing II 2,875% 15/1/2029	84.619	0,00	EUR 300.000	Cellnex Telecom 0,75% 20/11/2031	250.352	0,01
EUR 100.000	ZF Europe Finance 2,5% 23/10/2027	96.130	0,01	EUR 200.000	Cellnex Telecom 1,75% 23/10/2030*	178.176	0,01
USD 1.007.000	Ziggo 4,875% 15/1/2030	847.139	0,04	EUR 100.000	Cellnex Telecom 2,125% 11/8/2030	105.495	0,01
USD 732.000	Ziggo Bond 5,125% 28/2/2030*	568.108	0,03	EUR 100.000	Grifols 3,2% 1/5/2025	104.859	0,01
USD 680.000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	633.339	0,03	EUR 104.000	Grifols 3,875% 15/10/2028	98.192	0,00
		32.436.781	1,72	EUR 131.000	Grupo Antolin-Irausa 3,5% 30/4/2028	105.320	0,01
	Panama			EUR 100.000	International Consolidated Airlines 3,75% 25/3/2029*	94.928	0,00
USD 2.686.000	Carnival 4% 1/8/2028	2.411.555	0,13	EUR 338.000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	341.232	0,02
USD 6.632.000	Carnival 5,75% 1/3/2027	6.229.347	0,33			4.340.425	0,23
USD 3.901.000	Carnival 6% 1/5/2029	3.507.831	0,19		Suède		
USD 964.000	Carnival 7% 15/8/2029	979.807	0,05	EUR 100.000	Dometic 3% 8/5/2026	102.211	0,01
USD 1.268.000	Carnival 7,625% 1/3/2026	1.265.146	0,07	EUR 100.000	Fastighets Balder 2,873% 2/6/2081	72.984	0,00
EUR 129.000	Carnival 7,625% 1/3/2026	139.656	0,01	EUR 100.000	Heimstaden Bostad 1,125% 21/1/2026	90.702	0,01
USD 2.057.000	Carnival 9,875% 1/8/2027	2.175.689	0,12	EUR 850.000	Heimstaden Bostad 2,625% 1/2/2027	400.375	0,02
		16.709.031	0,90	EUR 88.068	Intrum 3,125% 15/7/2024	91.042	0,01
	Pologne			EUR 200.000	Intrum 4,875% 15/8/2025*	188.230	0,01
USD 983.000	Canpack / Canpack US 3,125% 1/11/2025	913.275	0,05	EUR 542.000	Verisure 3,25% 15/2/2027	530.253	0,03
	Portugal			EUR 100.000	Verisure 9,25% 15/10/2027	115.849	0,00
EUR 3.100.000	Banco Espirito Santo 2,625% 8/5/2017***	723.116	0,04			1.591.646	0,09
EUR 4.400.000	Banco Espirito Santo 4,75% 15/1/2018***	1.026.358	0,05		Suisse		
				USD 1.820.000	UBS 4,375% 10/2/2031	1.347.710	0,07
				USD 200.000	UBS 7% 19/2/2025*	195.236	0,01
				EUR 161.000	UBS 7,75% 1/3/2029	197.510	0,01
						1.740.456	0,09
					Royaume-Uni		
				EUR 400.000	Agps Bondco 5,5% 13/11/2026	145.925	0,01
				EUR 100.000	Agps Bondco 6% 5/8/2025	42.199	0,00
				EUR 311.000	Allwyn Entertainment Financing UK 7,25% 30/4/2030	344.656	0,02
				USD 1.000.000	Allwyn Entertainment Financing UK 7,875% 30/4/2029*	1.016.525	0,05

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 627.254	Ardonagh Midco 2 11,5% 15/1/2027*	615.676	0,03	GBP 136.000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	157.488	0,01
USD 4.605.000	Barclays 4,375% 15/3/2028	3.167.698	0,17	GBP 200.000	Virgin Media Secured Finance 5,25% 15/5/2029	215.977	0,01
USD 1.400.000	Barclays 5,2% 12/5/2026	1.359.034	0,07	GBP 200.000	Vmed O2 UK Financing I 4% 31/1/2029	203.270	0,01
USD 252.000	Barclays 8% 15/6/2024	247.216	0,01	GBP 469.000	Vmed O2 UK Financing I 4,5% 15/7/2031	462.079	0,02
USD 1.345.000	Barclays 8% 15/3/2029*	1.200.829	0,07	USD 1.271.000	Vmed O2 UK Financing I 4,75% 15/7/2031	1.058.886	0,06
GBP 300.000	BCP V Modular Services Finance II 6,125% 30/11/2028	312.045	0,02	EUR 300.000	Vodafone 2,625% 27/8/2080	297.459	0,02
GBP 300.000	Bellis Acquisition 3,25% 16/2/2026	326.959	0,02	EUR 100.000	Vodafone 3% 27/8/2080	89.150	0,00
GBP 350.000	Bellis Acquisition 4,5% 16/2/2026	389.655	0,02	EUR 100.000	Vodafone 4,2% 3/10/2078	100.493	0,01
USD 200.000	British Telecommunications 4,25% 23/11/2081	176.598	0,01	GBP 189.000	Vodafone 4,875% 3/10/2078	225.822	0,01
GBP 250.000	British Telecommunications 8,375% 20/12/2083	317.408	0,02	EUR 100.000	Vodafone 6,5% 30/8/2084*	109.973	0,01
GBP 200.000	BUPA Finance 4% 24/9/2031*	152.828	0,01			27.275.788	1,46
EUR 107.710	Codere New Topco 7,5% 30/11/2027	5.552	0,00	États-Unis			
GBP 149.000	Constellation Automotive Financing 4,875% 15/7/2027*	151.466	0,01	USD 498.000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	459.990	0,02
EUR 190.000	EC Finance 3% 15/10/2026	193.964	0,01	USD 778.000	Acadia Healthcare 5,5% 17/2/2028	735.970	0,04
USD 2.870.000	eG Global Finance 6,75% 7/2/2025	2.822.343	0,15	USD 1.721.000	ACI Worldwide 5,75% 15/8/2026*	1.685.075	0,09
USD 1.768.000	eG Global Finance 8,5% 30/10/2025	1.752.479	0,09	USD 997.000	Acrisure / Acrisure Finance 6% 1/8/2029	866.396	0,05
USD 252.000	EnQuest 11,625% 1/11/2027	238.709	0,01	USD 4.238.000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	3.436.785	0,18
GBP 159.000	Gatwick Airport Finance 4,375% 7/4/2026*	184.925	0,01	USD 267.000	AdaptHealth 5,125% 1/3/2030	220.208	0,01
GBP 100.000	Greene King Finance 6,903% 15/12/2034	100.924	0,01	USD 546.000	AdaptHealth 6,125% 1/8/2028	493.298	0,03
GBP 100.000	Greene King Finance 7,08% 15/3/2036	100.109	0,01	USD 349.000	ADT Security 4,875% 15/7/2032	301.556	0,02
USD 773.000	Harbour Energy 5,5% 15/10/2026	722.484	0,04	USD 1.538.000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	1.468.304	0,08
GBP 186.000	Heathrow Finance 4,125% 1/9/2029	190.927	0,01	USD 2.589.000	Advanced Drainage Systems 6,375% 15/6/2030	2.561.531	0,14
GBP 120.000	Heathrow Finance 4,75% 1/3/2024	149.474	0,01	USD 5.376.000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8,25% 15/2/2026	5.407.718	0,29
USD 965.000	HSBC 4,6% 17/12/2030	748.798	0,04	USD 1.467.000	Ahead DB 6,625% 1/5/2028	1.268.321	0,07
EUR 127.000	INEOS Finance 6,625% 15/5/2028*	137.094	0,01	USD 3.436.000	AHP Health Partners 5,75% 15/7/2029	2.936.428	0,16
EUR 307.000	INEOS Quattro Finance 2 2,5% 15/1/2026	303.759	0,01	USD 1.050.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,25% 15/3/2026	977.313	0,05
GBP 120.000	Iron Mountain UK 3,875% 15/11/2025	143.395	0,01	USD 1.293.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3,5% 15/3/2029	1.121.236	0,06
USD 1.535.000	Lloyds Banking 8% 27/9/2029	1.393.230	0,08	USD 1.924.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,625% 15/1/2027	1.821.682	0,10
USD 1.983.000	Merlin Entertainments 5,75% 15/6/2026	1.912.680	0,10	USD 329.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4,875% 15/2/2030	302.259	0,02
GBP 250.000	Mobico 4,25% 26/11/2025	276.617	0,01	USD 1.179.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5,875% 15/2/2028	1.144.984	0,06
GBP 200.000	Nationwide Building Society 5,75% 20/6/2027	218.235	0,01	USD 976.000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6,5% 15/2/2028	972.126	0,05
USD 600.000	Neptune Energy Bondco 6,625% 15/5/2025	597.540	0,03	USD 1.000.000	Alexander Funding Trust II 7,467% 31/7/2028	1.010.970	0,05
USD 434.000	Odeon Finco 12,75% 1/11/2027	427.416	0,02	USD 849.000	Allegiant Travel 7,25% 15/8/2027	831.854	0,04
GBP 100.000	Pinewood Finance 3,625% 15/11/2027*	110.197	0,01	USD 7.156.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4,25% 15/10/2027	6.517.606	0,35
GBP 190.000	Premier Foods Finance 3,5% 15/10/2026	217.918	0,01	USD 6.623.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 5,875% 1/11/2029	5.799.519	0,31
GBP 200.000	Santander UK 6,75% 24/6/2024	245.725	0,01	USD 12.971.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/10/2027	12.264.085	0,65
GBP 192.000	Stonegate Pub Financing 2019 8,25% 31/7/2025	225.122	0,01	USD 3.633.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/4/2028	3.583.933	0,19
EUR 207.000	Synthomer 3,875% 1/7/2025*	207.970	0,01	USD 6.434.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6% 1/6/2029	4.925.893	0,26
GBP 100.000	Thames Water Kemble Finance 4,625% 19/5/2026	85.883	0,00				
EUR 100.000	Thames Water Utilities Finance 4% 18/4/2027	103.884	0,01				
GBP 142.000	Unique Pub Finance 6,464% 30/3/2032	174.792	0,01				
USD 469.000	Virgin Media Secured Finance 4,5% 15/8/2030	396.329	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 6.301.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6,625% 15/7/2026	6.005.397	0,32	USD 1.945.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	1.906.850	0,10
USD 4.048.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 9,75% 15/7/2027	3.719.704	0,20	USD 810.000	Ares Capital 7% 15/1/2027	811.857	0,04
USD 1.541.000	Alteryx 8,75% 15/3/2028*	1.490.918	0,08	USD 1.798.000	Arko 5,125% 15/11/2029	1.479.017	0,08
USD 789.000	AMC Networks 4,25% 15/2/2029	504.480	0,03	USD 802.000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	818.015	0,04
USD 292.000	AMC Networks 4,75% 1/8/2025*	273.645	0,01	USD 31.000	Asbury Automotive 4,75% 1/3/2030	27.176	0,00
USD 353.000	American Airlines 7,25% 15/2/2028	347.331	0,02	USD 1.034.000	Asbury Automotive 5% 15/2/2032	886.328	0,05
USD 1.115.519	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,5% 20/4/2026	1.097.008	0,06	USD 1.288.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5,875% 30/6/2029	1.174.031	0,06
USD 3.584.412	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5,75% 20/4/2029*	3.444.697	0,18	USD 4.488.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 9% 1/11/2027	5.661.724	0,30
USD 150.000	American Builders & Contractors Supply 3,875% 15/11/2029	129.750	0,01	USD 1.161.000	Ashland 3,375% 1/9/2031	930.673	0,05
USD 1.225.000	American Express 5,625% 28/7/2034*	1.203.244	0,06	USD 1.525.000	Ashtead Capital 5,95% 15/10/2033	1.497.095	0,08
USD 1.760.000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9,375% 1/6/2028	1.799.974	0,10	USD 839.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/8/2029	723.512	0,04
USD 740.000	AMN Healthcare 4% 15/4/2029	633.404	0,03	USD 1.342.000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4,625% 1/4/2030	1.145.417	0,06
USD 973.000	Amsted Industries 5,625% 1/7/2027	945.776	0,05	USD 12.565.000	AthenaHealth 6,5% 15/2/2030	10.896.378	0,58
USD 2.743.000	AmWINS 4,875% 30/6/2029	2.462.959	0,13	USD 1.010.000	ATI 4,875% 1/10/2029	912.873	0,05
USD 1.511.000	ANGI 3,875% 15/8/2028	1.209.301	0,06	USD 2.749.000	ATI 5,125% 1/10/2031	2.433.030	0,13
USD 1.789.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,375% 15/6/2029	1.678.341	0,09	USD 1.072.000	ATI 5,875% 1/12/2027	1.044.375	0,05
USD 1.007.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5,75% 1/3/2027	977.217	0,05	USD 3.006.000	ATI 7,25% 15/8/2030	3.036.270	0,16
USD 573.000	Antero Resources 7,625% 1/2/2029	584.683	0,03	EUR 300.000	Avantor Funding 2,625% 1/11/2025	310.064	0,02
USD 2.120.000	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	1.927.068	0,10	EUR 165.000	Avantor Funding 3,875% 15/7/2028	165.323	0,01
USD 797.000	Apache 5,35% 1/7/2049	640.345	0,03	USD 1.028.000	Avantor Funding 3,875% 1/11/2029	901.659	0,05
USD 1.348.000	APi DE 4,125% 15/7/2029	1.166.226	0,06	USD 2.214.000	Avantor Funding 4,625% 15/7/2028	2.056.539	0,11
USD 997.000	APi DE 4,75% 15/10/2029	902.394	0,05	USD 658.000	Avient 7,125% 1/8/2030	659.464	0,03
USD 1.873.000	APX 5,75% 15/7/2029	1.617.037	0,09	USD 2.003.000	Axalta Coating Systems 3,375% 15/2/2029	1.700.557	0,09
USD 1.096.000	APX 6,75% 15/2/2027	1.061.698	0,06	USD 937.000	Axalta Coating Systems / Axalta Coating Systems Dutch B 4,75% 15/6/2027	882.138	0,05
USD 886.000	Aramark Services 5% 1/4/2025	875.868	0,05	USD 331.000	Ball 3,125% 15/9/2031	268.673	0,01
USD 2.916.000	Aramark Services 5% 1/2/2028	2.723.846	0,14	USD 1.141.000	Ball 6% 15/6/2029	1.123.935	0,06
USD 984.000	Aramark Services 6,375% 1/5/2025*	987.608	0,05	EUR 200.000	Banff Merger Sub 8,375% 1/9/2026	212.063	0,01
USD 256.000	Arches Buyer 4,25% 1/6/2028	223.216	0,01	USD 2.512.000	BCPE Empire 7,625% 1/5/2027	2.369.821	0,13
USD 7.341.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,25% 1/4/2028	7.026.438	0,37	USD 1.089.000	Beacon Roofing Supply 4,125% 15/5/2029	938.895	0,05
USD 2.890.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,875% 1/4/2027	2.845.639	0,15	USD 1.488.000	Beacon Roofing Supply 6,5% 1/8/2030	1.467.420	0,08
USD 3.649.000	Arcosa 4,375% 15/4/2029	3.267.132	0,17	USD 8.879.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	8.840.330	0,47
EUR 684.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029*	558.005	0,03	USD 1.565.000	Black Knight InfoServ 3,625% 1/9/2028	1.451.538	0,08
USD 716.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3,25% 1/9/2028	608.760	0,03	USD 504.000	Blackstone Private Credit Fund 3,25% 15/3/2027	439.355	0,02
USD 7.929.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029*	6.446.040	0,34	USD 516.000	Blackstone Private Credit Fund 7,05% 29/9/2025	519.326	0,03
				USD 3.590.000	Block 2,75% 1/6/2026	3.261.965	0,17
				USD 6.623.000	Block 3,5% 1/6/2031	5.446.189	0,29
				USD 625.000	Block Communications 4,875% 1/3/2028	517.818	0,03
				USD 428.000	Blue Owl Capital 3,4% 15/7/2026	385.727	0,02
				USD 1.199.000	Blue Owl Capital 3,75% 22/7/2025	1.124.408	0,06
				USD 288.000	Blue Owl Credit Income 3,125% 23/9/2026	253.751	0,01

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.456.000	Blue Owl Credit Income 5,5% 21/3/2025	1.411.516	0,08	USD 797.000	CCM Merger 6,375% 1/5/2026	774.402	0,04
USD 2.191.000	Blue Owl Credit Income 7,75% 16/9/2027	2.177.344	0,12	USD 4.443.000	CCO / CCO Capital 4,25% 1/2/2031	3.658.220	0,19
USD 2.171.000	Booz Allen Hamilton 3,875% 1/9/2028	1.968.782	0,10	USD 945.000	CCO / CCO Capital 4,25% 15/1/2034	724.674	0,04
USD 1.912.000	Booz Allen Hamilton 4% 1/7/2029	1.713.123	0,09	USD 568.000	CCO / CCO Capital 4,5% 15/8/2030	478.842	0,03
EUR 2.843.000	Boxer Parent 6,5% 2/10/2025	3.064.759	0,16	USD 1.935.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/3/2030	1.670.292	0,09
USD 2.437.000	Boxer Parent 7,125% 2/10/2025	2.442.240	0,13	USD 2.168.000	CCO / CCO Capital 4,75% 1/2/2032	1.799.906	0,10
USD 4.344.000	Boxer Parent 9,125% 1/3/2026	4.351.599	0,23	USD 1.227.000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	1.131.818	0,06
USD 1.786.000	Boyd Gaming 4,75% 1/12/2027	1.674.947	0,09	USD 1.214.000	CCO / CCO Capital 5,125% 1/5/2027	1.145.242	0,06
USD 1.857.000	Boyd Gaming 4,75% 15/6/2031	1.642.906	0,09	USD 912.000	CCO / CCO Capital 5,375% 1/6/2029	833.661	0,04
USD 2.196.000	Boyne USA 4,75% 15/5/2029	1.981.816	0,10	USD 4.466.000	CCO / CCO Capital 6,375% 1/9/2029	4.238.028	0,22
USD 8.918.000	Brand Industrial Services 10,375% 1/8/2030	9.158.926	0,49	USD 7.531.000	CCO / CCO Capital 7,375% 1/3/2031	7.492.854	0,40
USD 604.000	Brink's 5,5% 15/7/2025	595.239	0,03	USD 2.081.000	CD&R Smokey Buyer 6,75% 15/7/2025*	2.028.143	0,11
USD 1.446.000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGSJ Sellco LL 4,5% 1/4/2027	1.209.130	0,06	USD 2.998.000	CDI Escrow Issuer 5,75% 1/4/2030	2.801.441	0,15
USD 1.334.000	Buckeye Partners 4,125% 1/3/2025	1.283.575	0,07	USD 868.000	CDW / CDW Finance 3,25% 15/2/2029	754.899	0,04
USD 663.000	Buckeye Partners 5,6% 15/10/2044	488.083	0,03	USD 538.000	Cedar Fair 5,25% 15/7/2029*	484.854	0,03
USD 867.000	Buckeye Partners 5,85% 15/11/2043	670.343	0,04	USD 990.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,5% 1/5/2025	983.490	0,05
USD 569.000	Cable One 0% 15/3/2026	470.523	0,02	USD 476.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 6,5% 1/10/2028	460.872	0,02
USD 2.259.000	Cable One 1,125% 15/3/2028	1.712.928	0,09	USD 3.726.000	Centene 3% 15/10/2030	3.096.171	0,16
USD 2.059.000	Cable One 4% 15/11/2030	1.607.744	0,08	USD 844.000	Central Garden & Pet 4,125% 15/10/2030	727.271	0,04
USD 800.000	Cablevision Lightpath 3,875% 15/9/2027	666.281	0,04	USD 1.592.000	Central Garden & Pet 4,125% 30/4/2031*	1.359.792	0,07
USD 1.109.000	Cablevision Lightpath 5,625% 15/9/2028*	853.510	0,04	USD 2.590.000	Central Parent / CDK Global 7,25% 15/6/2029	2.559.609	0,14
USD 2.455.000	Caesars Entertainment 4,625% 15/10/2029*	2.153.897	0,11	USD 2.624.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	2.659.436	0,14
USD 5.816.000	Caesars Entertainment 6,25% 1/7/2025	5.774.577	0,31	USD 730.000	Charles River Laboratories International 4,25% 1/5/2028	669.978	0,04
USD 7.510.000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	7.526.793	0,40	USD 4.025.000	Chart Industries 7,5% 1/1/2030	4.135.269	0,22
USD 5.428.000	Caesars Entertainment 8,125% 1/7/2027*	5.521.459	0,29	USD 600.000	Chart Industries 9,5% 1/1/2031	647.373	0,03
USD 1.253.000	Callon Petroleum 6,375% 1/7/2026	1.237.776	0,07	USD 516.000	Chemours 4,625% 15/11/2029	429.396	0,02
USD 5.391.000	Callon Petroleum 7,5% 15/6/2030*	5.307.512	0,28	USD 1.184.000	Chemours 5,75% 15/11/2028	1.061.146	0,06
USD 4.267.000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	4.328.415	0,23	USD 2.480.000	Cheniere Energy Partners 3,25% 31/1/2032	2.048.537	0,11
USD 236.000	Calpine 4,625% 1/2/2029	205.327	0,01	USD 2.361.000	Cheniere Energy Partners 4,5% 1/10/2029	2.179.430	0,12
USD 495.000	Calpine 5% 1/2/2031	420.053	0,02	USD 3.727.000	Chesapeake Energy 6,75% 15/4/2029	3.703.109	0,20
USD 2.198.000	Calpine 5,125% 15/3/2028	2.010.040	0,11	USD 5.664.000	Chobani / Chobani Finance 4,625% 15/11/2028	5.087.456	0,27
USD 1.565.000	Camelot Return Merger Sub 8,75% 1/8/2028*	1.551.572	0,08	USD 5.822.000	Chobani / Chobani Finance 7,5% 15/4/2025	5.813.619	0,31
USD 805.000	Capital One Financial 6,312% 8/6/2029	804.338	0,04	USD 2.990.000	CHS/Community Health Systems 4,75% 15/2/2031	2.249.676	0,12
USD 575.000	Capital One Financial 6,377% 8/6/2034	569.345	0,03	USD 2.978.000	CHS/Community Health Systems 5,25% 15/5/2030	2.349.482	0,13
USD 1.841.000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	1.814.793	0,10	USD 910.000	CHS/Community Health Systems 5,625% 15/3/2027	804.723	0,04
USD 870.000	Carpenter Technology 6,375% 15/7/2028	851.121	0,04	USD 5.052.000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	4.236.759	0,22
USD 1.247.000	Carpenter Technology 7,625% 15/3/2030	1.257.072	0,07				
EUR 229.000	Catalent Pharma Solutions 2,375% 1/3/2028	208.093	0,01				
USD 1.668.000	Catalent Pharma Solutions 3,125% 15/2/2029	1.402.621	0,07				
USD 1.368.000	Catalent Pharma Solutions 3,5% 1/4/2030	1.151.397	0,06				
USD 827.000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	773.009	0,04				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 2.221.000	Churchill Downs 4,75% 15/1/2028	2.052.829	0,11	USD 1.490.000	Covanta 4,875% 1/12/2029	1.282.853	0,07
USD 1.052.000	Churchill Downs 5,5% 1/4/2027	1.014.382	0,05	USD 497.000	Covanta 5% 1/9/2030	422.357	0,02
USD 2.395.000	Churchill Downs 6,75% 1/5/2031	2.336.609	0,12	USD 5.099.000	CQP Holdco / BIP-V Chinook Holdco 5,5% 15/6/2031	4.645.582	0,25
USD 2.435.000	Citigroup 6,174% 25/5/2034	2.432.741	0,13	USD 6.572.000	Crescent Energy Finance 7,25% 1/5/2026	6.467.122	0,34
USD 4.759.000	Civitas Resources 8,375% 1/7/2028	4.892.268	0,26	USD 1.678.000	Crescent Energy Finance 9,25% 15/2/2028	1.717.544	0,09
USD 3.739.000	Civitas Resources 8,75% 1/7/2031	3.864.674	0,20	USD 469.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 5,625% 1/5/2027	455.605	0,02
USD 1.522.000	Clarios Global 6,75% 15/5/2025	1.524.819	0,08	USD 2.514.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	2.447.948	0,13
EUR 1.820.000	Clarios Global / Clarios US Finance 4,375% 15/5/2026	1.912.223	0,10	USD 627.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 7,375% 1/2/2031	644.904	0,03
USD 3.234.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,25% 15/5/2026*	3.204.673	0,17	USD 516.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 8% 1/4/2029	533.370	0,03
USD 4.843.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,75% 15/5/2028	4.835.459	0,26	USD 1.243.000	Crocs 4,125% 15/8/2031	986.196	0,05
USD 14.939.000	Clarios Global / Clarios US Finance 8,5% 15/5/2027	15.117.237	0,80	USD 129.000	Crocs 4,25% 15/3/2029	108.891	0,01
USD 6.482.000	Clarivate Science 3,875% 1/7/2028	5.716.345	0,30	USD 260.000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	223.053	0,01
USD 3.773.000	Clarivate Science 4,875% 1/7/2029	3.296.066	0,18	USD 130.000	Crown Americas 5,25% 1/4/2030*	122.254	0,01
USD 467.000	Clean Harbors 4,875% 15/7/2027	447.424	0,02	USD 474.000	Crown Americas / Crown Americas Capital V 4,25% 30/9/2026	447.224	0,02
USD 895.000	Clean Harbors 5,125% 15/7/2029	847.261	0,04	USD 340.000	Crown Cork & Seal 7,375% 15/12/2026	351.645	0,02
USD 708.000	Clean Harbors 6,375% 1/2/2031	704.843	0,04	USD 516.000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	477.909	0,02
USD 5.680.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	5.099.582	0,27	USD 6.528.000	CrownRock / CrownRock Finance 5,625% 15/10/2025	6.419.635	0,34
USD 4.937.000	Clear Channel Outdoor 7,5% 1/6/2029	3.683.875	0,20	USD 2.389.000	CSC 4,125% 1/12/2030	1.705.724	0,09
USD 1.178.000	Clear Channel Outdoor 7,75% 15/4/2028	923.241	0,05	USD 759.000	CSC 4,5% 15/11/2031	541.030	0,03
USD 4.641.000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	4.663.741	0,25	USD 3.044.000	CSC 5,5% 15/4/2027	2.627.019	0,14
USD 1.667.000	Clearway Energy Operating 3,75% 15/11/2032	1.361.901	0,07	USD 662.000	CSC 6,5% 1/2/2029	547.900	0,03
USD 458.000	Clearway Energy Operating 4,75% 15/3/2028	424.840	0,02	USD 8.240.000	CSC 11,25% 15/5/2028	8.134.115	0,43
USD 22.535.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	20.156.714	1,07	USD 2.281.000	Cushman & Wakefield US Borrower 6,75% 15/5/2028	2.158.864	0,11
USD 8.974.000	Cloud Software 9% 30/9/2029	8.025.920	0,43	USD 854.000	Cushman & Wakefield US Borrower 8,875% 1/9/2031	863.505	0,05
USD 3.736.000	Clydesdale Acquisition 6,625% 15/4/2029	3.560.247	0,19	USD 2.786.000	Darling Ingredients 6% 15/6/2030	2.729.409	0,14
USD 3.062.000	Clydesdale Acquisition 8,75% 15/4/2030	2.770.454	0,15	USD 668.000	DCP Midstream Operating 6,45% 3/11/2036	681.615	0,04
USD 1.858.000	CMG Media 8,875% 15/12/2027	1.459.417	0,08	USD 1.133.000	Dealer Tire / DT Issuer 8% 1/2/2028*	1.058.758	0,06
USD 1.765.000	CNX Midstream Partners 4,75% 15/4/2030	1.524.765	0,08	USD 1.514.000	Diamondback Energy 6,25% 15/3/2033	1.562.103	0,08
USD 705.000	CNX Resources 7,375% 15/1/2031	703.673	0,04	USD 3.999.000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5,875% 15/8/2027	3.552.631	0,19
USD 2.342.000	Coherent 5% 15/12/2029	2.074.083	0,11	USD 545.000	Discover Financial Services 6,7% 29/11/2032	542.834	0,03
USD 2.329.000	CommScope 4,75% 1/9/2029	1.732.382	0,09	USD 261.000	Drawbridge Special Opportunities Fund / Drawbridge Special Opportunities Fin 3,875% 15/2/2026	233.422	0,01
USD 2.191.000	CommScope 6% 1/3/2026	1.986.874	0,11	USD 660.000	Dream Finders Homes 8,25% 15/8/2028	669.782	0,04
USD 2.192.000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	2.005.860	0,11	USD 3.219.000	DT Midstream 4,125% 15/6/2029	2.850.616	0,15
USD 1.594.000	Compass Diversified 5,25% 15/4/2029*	1.465.095	0,08	USD 2.561.000	DT Midstream 4,375% 15/6/2031	2.212.431	0,12
USD 717.000	Consensus Cloud Solutions 6% 15/10/2026	668.302	0,04	USD 3.825.000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029*	3.418.741	0,18
USD 644.000	Consensus Cloud Solutions 6,5% 15/10/2028*	579.641	0,03	USD 1.019.000	Dycom Industries 4,5% 15/4/2029	911.516	0,05
USD 7.697.000	CoreLogic 4,5% 1/5/2028	6.299.225	0,33				
EUR 279.000	Coty 3,875% 15/4/2026*	294.445	0,02				
USD 127.000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 4,75% 15/1/2029	116.479	0,01				
USD 1.503.000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030*	1.498.794	0,08				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 10.332.000	Element Solutions 3,875% 1/9/2028	9.086.120	0,48	GBP 263.000	Ford Motor Credit 4,535% 6/3/2025	318.849	0,02
USD 675.000	Embecta 6,75% 15/2/2030	595.630	0,03	USD 698.000	Ford Motor Credit 4,687% 9/6/2025	673.337	0,04
EUR 935.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	1.013.526	0,05	USD 799.000	Ford Motor Credit 5,113% 3/5/2029	735.161	0,04
EUR 100.000	Emerald Debt Merger Sub 6,375% 15/12/2030	108.519	0,01	USD 1.171.000	Ford Motor Credit 5,125% 16/6/2025	1.140.631	0,06
USD 14.898.000	Emerald Debt Merger Sub 6,625% 15/12/2030	14.660.554	0,78	EUR 100.000	Ford Motor Credit 6,125% 15/5/2028	111.410	0,01
USD 3.523.000	Enact 6,5% 15/8/2025	3.494.023	0,19	USD 3.574.000	Ford Motor Credit 6,8% 12/5/2028*	3.574.804	0,19
USD 281.000	Encompass Health 4,5% 1/2/2028	261.771	0,01	GBP 174.000	Ford Motor Credit 6,86% 5/6/2026	215.301	0,01
USD 1.728.000	Encompass Health 4,625% 1/4/2031	1.514.831	0,08	USD 4.147.000	Ford Motor Credit 7,2% 10/6/2030	4.198.862	0,22
GBP 317.000	Encore Capital 4,25% 1/6/2028	309.927	0,02	USD 714.000	Ford Motor Credit 7,35% 4/11/2027	727.340	0,04
GBP 100.000	Encore Capital 5,375% 15/2/2026*	114.305	0,01	USD 4.710.000	Ford Motor Credit 7,35% 6/3/2030	4.799.410	0,25
USD 1.902.000	EnLink Midstream 5,375% 1/6/2029	1.818.058	0,10	USD 1.146.000	Fortrea 7,5% 1/7/2030	1.132.248	0,06
USD 2.751.000	EnLink Midstream 5,625% 15/1/2028	2.664.298	0,14	USD 813.000	Foundation Building Materials 6% 1/3/2029	688.224	0,04
USD 1.739.000	EnLink Midstream 6,5% 1/9/2030	1.747.309	0,09	USD 2.923.000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	2.505.551	0,13
USD 788.000	EnLink Midstream Partners 4,15% 1/6/2025	757.404	0,04	USD 730.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	665.221	0,04
USD 601.000	EnLink Midstream Partners 4,85% 15/7/2026	577.519	0,03	USD 7.902.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	7.671.241	0,41
USD 539.000	EnLink Midstream Partners 5,45% 1/6/2047	447.893	0,02	USD 1.530.000	Garden Spinco 8,625% 20/7/2030	1.631.707	0,09
USD 1.579.000	EnLink Midstream Partners 5,6% 1/4/2044	1.329.204	0,07	USD 425.000	Gartner 4,5% 1/7/2028	396.905	0,02
USD 1.279.000	EnPro Industries 5,75% 15/10/2026	1.248.361	0,07	USD 2.621.000	Gates Global / Gates 6,25% 15/1/2026	2.603.659	0,14
USD 11.615.000	Entegris Escrow 4,75% 15/4/2029	10.794.949	0,57	USD 1.707.000	GCI 4,75% 15/10/2028	1.482.743	0,08
USD 955.000	EQM Midstream Partners 4,125% 1/12/2026	897.633	0,05	USD 838.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 6,5% 1/10/2025	826.224	0,04
USD 150.000	EQM Midstream Partners 4,5% 15/1/2029	136.236	0,01	USD 605.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7,75% 1/2/2028	590.364	0,03
USD 1.018.000	EQM Midstream Partners 4,75% 15/1/2031	901.159	0,05	USD 1.001.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8,875% 15/4/2030	996.680	0,05
USD 1.033.000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	1.024.076	0,05	USD 2.292.000	Global Payments 5,4% 15/8/2032	2.243.968	0,12
USD 754.000	EQM Midstream Partners 6,5% 1/7/2027	748.947	0,04	USD 1.547.000	GLP Capital / GLP Financing II 3,25% 15/1/2032	1.247.808	0,07
USD 677.000	EQM Midstream Partners 7,5% 1/6/2030	695.077	0,04	USD 880.000	Go Daddy Operating / GD Finance 3,5% 1/3/2029	758.080	0,04
USD 1.663.000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	1.521.886	0,08	USD 641.000	Go Daddy Operating / GD Finance 5,25% 1/12/2027	612.751	0,03
USD 472.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4,625% 15/1/2029	407.544	0,02	USD 1.226.000	Goodyear Tire & Rubber 5% 15/7/2029	1.088.619	0,06
USD 512.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 6,75% 15/1/2030	423.690	0,02	USD 327.000	Goodyear Tire & Rubber 5,625% 30/4/2033	280.968	0,01
USD 6.125.000	First-Citizens Bank & Trust 6% 1/4/2036	5.468.987	0,29	USD 245.000	GrafTech Finance 4,625% 15/12/2028	192.318	0,01
USD 830.000	Ford Motor 3,25% 12/2/2032*	649.156	0,03	USD 2.112.000	GrafTech Global Enterprises 9,875% 15/12/2028*	2.049.443	0,11
USD 2.208.000	Ford Motor 6,1% 19/8/2032	2.107.417	0,11	USD 459.000	Graham 5,75% 1/6/2026	449.079	0,02
USD 273.000	Ford Motor Credit 2,7% 10/8/2026	244.798	0,01	EUR 596.000	Graphic Packaging International 2,625% 1/2/2029	570.856	0,03
GBP 100.000	Ford Motor Credit 2,748% 14/6/2024	122.122	0,01	USD 417.000	Graphic Packaging International 3,5% 15/3/2028	372.089	0,02
USD 1.244.000	Ford Motor Credit 3,625% 17/6/2031	1.008.233	0,05	USD 620.000	Graphic Packaging International 4,75% 15/7/2027	589.638	0,03
USD 502.000	Ford Motor Credit 3,664% 8/9/2024	486.620	0,03	USD 801.000	Gray Television 5,875% 15/7/2026	733.773	0,04
USD 589.000	Ford Motor Credit 3,81% 9/1/2024	584.034	0,03	USD 480.000	Gray Television 7% 15/5/2027	431.450	0,02
USD 747.000	Ford Motor Credit 4,134% 4/8/2025	712.189	0,04	USD 2.509.000	GTCR AP Finance 8% 15/5/2027	2.484.803	0,13
USD 548.000	Ford Motor Credit 4,389% 8/1/2026	519.483	0,03				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 311.000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	316.113	0,02	USD 820.000	Installed Building Products 5,75% 1/2/2028	770.794	0,04
USD 2.585.000	GYP III 4,625% 1/5/2029	2.276.353	0,12	EUR 336.000	IQVIA 1,75% 15/3/2026*	339.080	0,02
USD 285.000	H&E Equipment Services 3,875% 15/12/2028	249.520	0,01	EUR 100.000	IQVIA 2,25% 15/3/2029	93.344	0,00
USD 796.000	Hanesbrands 4,875% 15/5/2026*	745.490	0,04	USD 1.965.000	IQVIA 5% 15/10/2026	1.901.633	0,10
USD 2.046.000	Hanesbrands 9% 15/2/2031*	2.055.117	0,11	USD 799.000	IQVIA 5% 15/5/2027	768.233	0,04
USD 1.809.000	HAT I / HAT II 3,375% 15/6/2026	1.624.803	0,09	USD 955.000	IQVIA 6,5% 15/5/2030	961.008	0,05
USD 1.005.000	HB Fuller 4,25% 15/10/2028	898.023	0,05	USD 1.466.000	IRB 7% 15/6/2025*	1.467.319	0,08
USD 4.784.000	HealthEquity 4,5% 1/10/2029	4.245.853	0,22	USD 211.000	Iron Mountain 5,625% 15/7/2032	189.580	0,01
USD 620.000	HEICO 5,35% 1/8/2033	614.804	0,03	USD 3.488.000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	3.485.738	0,19
USD 1.065.000	Helios Software / ION Corporate Solutions Finance 4,625% 1/5/2028	919.661	0,05	USD 926.000	Iron Mountain Information Management Services 5% 15/7/2032	801.117	0,04
USD 2.999.000	Herc 5,5% 15/7/2027	2.888.601	0,15	USD 3.408.000	ITT 6,5% 1/8/2029	3.096.134	0,16
USD 647.000	Hertz 4,625% 1/12/2026	584.096	0,03	USD 2.269.000	Jefferies Finance / JFIN Co-Issuer 5% 15/8/2028	1.947.329	0,10
USD 1.159.000	Hertz 5% 1/12/2029	953.610	0,05	USD 1.184.000	JELD-WEN 4,625% 15/12/2025	1.146.858	0,06
USD 1.413.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5,75% 1/2/2029	1.312.112	0,07	USD 365.000	K Hovnanian Enterprises 7,75% 15/2/2026	361.593	0,02
USD 126.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6% 15/4/2030	117.064	0,01	USD 2.478.000	Kaiser Aluminum 4,5% 1/6/2031	2.002.278	0,11
USD 827.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6,25% 1/11/2028	796.900	0,04	USD 1.047.000	Kaiser Aluminum 4,625% 1/3/2028	923.550	0,05
USD 30.000	Hilton Domestic Operating 3,625% 15/2/2032	24.953	0,00	USD 533.000	KB Home 7,25% 15/7/2030	537.557	0,03
USD 631.000	Hilton Domestic Operating 3,75% 1/5/2029	556.955	0,03	USD 943.000	Ken Garff Automotive 4,875% 15/9/2028	821.320	0,04
USD 97.000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	84.122	0,00	USD 2.422.000	Kinetik 5,875% 15/6/2030	2.344.871	0,12
USD 1.093.000	Hilton Domestic Operating 4,875% 15/1/2030	1.020.301	0,05	USD 2.429.000	Kobe US Midco 2 9,25% 1/11/2026	1.776.206	0,09
USD 777.000	Hilton Domestic Operating 5,375% 1/5/2025	772.241	0,04	USD 983.000	Kontoor Brands 4,125% 15/11/2029	834.792	0,04
USD 881.000	Hilton Domestic Operating 5,75% 1/5/2028	865.139	0,05	EUR 234.000	Kronos International 3,75% 15/9/2025	231.386	0,01
USD 7.824.000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	7.335.777	0,39	USD 1.317.000	LABL 5,875% 1/11/2028	1.193.391	0,06
USD 1.475.000	Howard Hughes 4,125% 1/2/2029	1.214.633	0,06	USD 65.000	LABL 6,75% 15/7/2026	63.586	0,00
USD 327.000	Howard Hughes 4,375% 1/2/2031	260.296	0,01	USD 2.682.000	LABL 9,5% 1/11/2028	2.764.179	0,15
USD 245.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	221.254	0,01	USD 920.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,25% 1/2/2027	833.006	0,04
USD 1.532.000	Howard Midstream Energy Partners 8,875% 15/7/2028	1.576.046	0,08	USD 591.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,75% 15/6/2029	497.302	0,03
USD 42.000	Howmet Aerospace 5,125% 1/10/2024	41.606	0,00	USD 273.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5,25% 1/10/2025	263.049	0,01
USD 5.022.000	HUB International 7% 1/5/2026	5.018.608	0,27	USD 421.000	Lamb Weston 4,125% 31/1/2030	371.184	0,02
USD 9.340.000	HUB International 7,25% 15/6/2030	9.466.566	0,50	USD 1.172.000	Lamb Weston 4,375% 31/1/2032	1.015.187	0,05
USD 543.000	Hughes Satellite Systems 5,25% 1/8/2026	495.761	0,03	USD 2.048.000	Lamb Weston 4,875% 15/5/2028	1.937.182	0,10
USD 1.752.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4,375% 1/2/2029*	1.386.664	0,07	USD 2.701.000	LCM Investments II 4,875% 1/5/2029	2.346.552	0,12
USD 975.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4,75% 15/9/2024	943.418	0,05	USD 1.468.000	LCM Investments II 8,25% 1/8/2031	1.470.099	0,08
USD 4.556.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5,25% 15/5/2027	3.993.667	0,21	USD 1.430.000	Legacy LifePoint Health 4,375% 15/2/2027	1.236.950	0,07
USD 1.396.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6,25% 15/5/2026	1.296.336	0,07	EUR 7.949.053	Lehman Brothers 0% 5/2/2014***	44.846	0,00
USD 4.429.000	Illuminate Buyer / Illuminate IV 9% 1/7/2028*	4.104.688	0,22	USD 1.610.000	Lehman Brothers 0% 1/3/2015***	3.623	0,00
USD 2.905.000	Imola Merger 4,75% 15/5/2029	2.587.480	0,14	EUR 3.724.306	Lehman Brothers 4,75% 16/1/2014***	21.011	0,00
USD 664.000	Ingevity 3,875% 1/11/2028	563.044	0,03	EUR 639.529	Lehman Brothers 5,375% 17/10/2012***	3.608	0,00
				USD 5.760.000	Lehman Brothers 5,75% 17/5/2013***	12.960	0,00
				USD 5.060.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	4.632.741	0,24

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 531.000	Level 3 Financing 3,625% 15/1/2029	316.604	0,02	USD 1.104.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance 5,375% 15/8/2027	1.042.971	0,06
USD 5.799.000	Level 3 Financing 4,625% 15/9/2027	4.368.332	0,23	USD 1.181.000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4,875% 1/5/2029	1.028.560	0,05
USD 5.477.000	Level 3 Financing 10,5% 15/5/2030	5.566.579	0,30	USD 2.192.149	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6,5% 20/6/2027	2.186.156	0,12
USD 1.428.000	Levi Strauss 3,5% 1/3/2031	1.158.233	0,06	USD 2.802.000	Minerals Technologies 5% 1/7/2028	2.563.172	0,14
EUR 193.000	Liberty Mutual 3,625% 23/5/2059	199.875	0,01	USD 2.088.000	ModivCare 5,875% 15/11/2025*	1.983.308	0,10
USD 2.740.000	Life Time 5,75% 15/1/2026	2.674.661	0,14	USD 404.000	Molina Healthcare 3,875% 15/11/2030	345.551	0,02
USD 2.178.000	Life Time 8% 15/4/2026*	2.175.713	0,12	USD 534.000	Molina Healthcare 3,875% 15/5/2032	443.036	0,02
USD 2.045.000	LifePoint Health 9,875% 15/8/2030	2.018.614	0,11	USD 462.000	Molina Healthcare 4,375% 15/6/2028	425.417	0,02
USD 1.067.000	Light & Wonder International 7% 15/5/2028	1.065.145	0,06	GBP 1.336.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2,5% 24/3/2026	1.330.892	0,07
USD 132.000	Light & Wonder International 7,25% 15/11/2029	132.284	0,01	GBP 654.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2,55% 5/12/2023	802.054	0,04
USD 1.098.000	Light & Wonder International 7,5% 1/9/2031	1.113.238	0,06	USD 2.130.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 3,5% 15/3/2031	1.382.261	0,07
USD 2.521.000	Lindblad Expeditions 6,75% 15/2/2027	2.444.387	0,13	USD 3.597.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4,625% 1/8/2029	2.605.868	0,14
USD 1.500.000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	1.542.690	0,08	USD 298.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5,25% 1/8/2026	253.616	0,01
USD 2.007.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	1.214.745	0,06	USD 397.000	MSCI 3,25% 15/8/2033	319.691	0,02
USD 1.152.000	Lithia Motors 3,875% 1/6/2029	990.320	0,05	USD 653.000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	576.857	0,03
USD 915.000	Live Nation Entertainment 3,75% 15/1/2028	816.965	0,04	USD 3.000	Murphy Oil 5,75% 15/8/2025	2.971	0,00
USD 1.528.000	Live Nation Entertainment 4,75% 15/10/2027*	1.419.262	0,07	USD 704.000	Murphy Oil 5,875% 1/12/2027	692.653	0,04
USD 297.000	Live Nation Entertainment 4,875% 1/11/2024	291.944	0,02	USD 196.000	Murphy Oil 5,875% 1/12/2042	165.327	0,01
USD 104.000	Live Nation Entertainment 5,625% 15/3/2026	100.963	0,01	USD 3.601.000	Nabors Industries 5,75% 1/2/2025	3.534.724	0,18
USD 8.145.000	Live Nation Entertainment 6,5% 15/5/2027	8.156.354	0,43	USD 1.752.000	Nabors Industries 7,375% 15/5/2027	1.714.770	0,09
USD 1.265.000	LSF11 A5 HoldCo 6,625% 15/10/2029	1.056.299	0,06	USD 367.000	Nationstar Mortgage 5,125% 15/12/2030	310.048	0,02
USD 2.535.000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	1.586.771	0,09	USD 906.000	Nationstar Mortgage 5,75% 15/11/2031	777.865	0,05
USD 2.487.000	Madison IAQ 5,875% 30/6/2029	2.095.217	0,11	USD 88.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	83.900	0,00
USD 248.000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	240.603	0,01	USD 518.000	Navient 5,5% 15/3/2029	443.412	0,02
USD 335.000	MasTec 4,5% 15/8/2028	305.644	0,02	USD 386.000	Navient 5,875% 25/10/2024	380.633	0,02
USD 2.589.000	Mataador Resources 5,875% 15/9/2026	2.526.693	0,13	USD 381.000	Navient 6,125% 25/3/2024	379.496	0,02
USD 1.510.000	Mataador Resources 6,875% 15/4/2028	1.511.838	0,08	USD 264.000	Navient 7,25% 25/9/2023	264.396	0,01
USD 1.022.000	Match II 3,625% 1/10/2031	831.295	0,04	USD 895.000	Navient 9,375% 25/7/2030	897.587	0,05
USD 1.037.000	Match II 4,625% 1/6/2028	956.363	0,05	USD 507.000	NCR 5% 1/10/2028	465.623	0,02
USD 39.000	Match II 5,625% 15/2/2029	36.806	0,00	USD 104.000	NCR 5,125% 15/4/2029	94.582	0,00
USD 611.000	Mattel 5,45% 1/11/2041	526.743	0,03	USD 1.923.000	Neptune Bidco US 9,29% 15/4/2029	1.793.028	0,10
USD 2.407.000	Mattel 6,2% 1/10/2040	2.250.758	0,12	USD 2.151.000	NESCO II 5,5% 15/4/2029	1.955.291	0,10
USD 17.910.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	17.616.833	0,93	USD 1.019.000	New Enterprise Stone & Lime 5,25% 15/7/2028	941.095	0,05
USD 580.000	Mauser Packaging Solutions 9,25% 15/4/2027	526.630	0,03	USD 1.108.000	New Enterprise Stone & Lime 9,75% 15/7/2028	1.099.460	0,06
USD 5.726.000	McAfee 7,375% 15/2/2030	5.015.873	0,27	USD 2.839.000	New Fortress Energy 6,5% 30/9/2026	2.640.337	0,14
USD 1.344.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	1.171.254	0,06	USD 4.943.000	New Fortress Energy 6,75% 15/9/2025	4.783.071	0,26
USD 8.922.000	Medline Borrower 5,25% 1/10/2029*	7.944.721	0,42	USD 1.604.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/7/2024	1.575.374	0,08
USD 1.547.000	Metis Merger Sub 6,5% 15/5/2029*	1.346.732	0,07	USD 65.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/9/2024	62.439	0,00
USD 1.225.000	MGIC Investment 5,25% 15/8/2028	1.169.179	0,06	USD 3.481.000	NFP 4,875% 15/8/2028	3.111.007	0,17
USD 1.323.000	MGM Resorts International 5,75% 15/6/2025	1.307.042	0,07	USD 11.875.000	NFP 6,875% 15/8/2028	10.464.048	0,56
USD 3.373.000	MicroStrategy 6,125% 15/6/2028	3.021.771	0,16	USD 789.000	NFP 7,5% 1/10/2030	767.636	0,04

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 3.328.000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7,5% 1/2/2026	3.306.872	0,18	USD 770.000	PBF / PBF Finance 7,875% 15/9/2030	768.833	0,04
USD 546.000	Nine Energy Service 13% 1/2/2028	496.029	0,03	USD 136.000	PDC Energy 5,75% 15/5/2026	135.915	0,01
USD 1.862.000	Noble Finance II 8% 15/4/2030	1.927.445	0,10	USD 1.483.000	Penske Automotive 3,5% 1/9/2025	1.416.458	0,08
USD 1.555.000	Northern Trust 6,125% 2/11/2032	1.586.288	0,08	USD 670.000	Permian Resources Operating 5,375% 15/1/2026	649.162	0,03
USD 1.892.000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4,75% 30/4/2027	1.651.384	0,09	USD 3.844.000	Permian Resources Operating 5,875% 1/7/2029	3.720.048	0,20
USD 6.562.000	Novelis 3,25% 15/11/2026	5.955.642	0,32	USD 1.246.000	Permian Resources Operating 6,875% 1/4/2027	1.239.080	0,07
USD 3.114.000	Novelis 3,875% 15/8/2031	2.581.669	0,14	USD 3.654.000	Permian Resources Operating 7,75% 15/2/2026	3.695.217	0,20
USD 2.768.000	Novelis 4,75% 30/1/2030	2.483.471	0,13	USD 708.000	PetSmart / PetSmart Finance 4,75% 15/2/2028	635.923	0,03
USD 1.145.000	NRG Energy 7% 15/3/2033	1.131.237	0,06	USD 4.192.000	PetSmart / PetSmart Finance 7,75% 15/2/2029	4.007.302	0,21
USD 2.307.000	NuStar Logistics 5,75% 1/10/2025	2.263.781	0,12	USD 445.000	Playtika 4,25% 15/3/2029	384.769	0,02
USD 811.000	NuStar Logistics 6% 1/6/2026	796.035	0,04	USD 77.000	Post 4,5% 15/9/2031	66.226	0,00
USD 228.000	NuStar Logistics 6,375% 1/10/2030	219.668	0,01	USD 328.000	Post 4,625% 15/4/2030	290.874	0,02
USD 1.095.000	Occidental Petroleum 6,2% 15/3/2040	1.079.555	0,06	USD 16.000	Post 5,75% 1/3/2027	15.657	0,00
USD 588.000	Occidental Petroleum 6,45% 15/9/2036	600.042	0,03	USD 3.204.000	PRA Health Sciences 2,875% 15/7/2026	2.917.061	0,15
EUR 260.000	Olympus Water US 9,625% 15/11/2028	282.566	0,01	USD 1.047.000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5,625% 1/9/2029	818.304	0,04
USD 3.180.000	Olympus Water US 9,75% 15/11/2028*	3.206.210	0,17	USD 1.268.000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5,875% 1/9/2031	957.213	0,05
USD 797.000	OneMain Finance 3,5% 15/1/2027	691.237	0,04	USD 299.000	Presidio 4,875% 1/2/2027	279.637	0,01
USD 561.000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	437.476	0,02	USD 990.000	Prestige Brands 3,75% 1/4/2031	820.116	0,04
USD 435.000	OneMain Finance 5,375% 15/11/2029	378.423	0,02	USD 1.598.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5,75% 15/4/2026	1.570.245	0,08
USD 1.130.000	OneMain Finance 6,625% 15/1/2028	1.058.972	0,06	USD 2.170.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6,25% 15/1/2028	2.075.144	0,11
USD 2.107.000	OneMain Finance 6,875% 15/3/2025	2.098.690	0,11	USD 1.235.000	PTC 3,625% 15/2/2025	1.194.541	0,06
USD 1.515.000	OneMain Finance 7,125% 15/3/2026	1.493.335	0,08	USD 2.546.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4,5% 15/9/2026	1.988.921	0,11
USD 1.417.000	Option Care Health 4,375% 31/10/2029	1.248.198	0,07	USD 6.783.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6,5% 15/9/2028	3.670.351	0,19
USD 1.467.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4,125% 30/4/2028	1.327.952	0,07	USD 1.628.000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4,875% 1/11/2026	1.527.670	0,08
USD 2.138.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5,125% 30/4/2031	1.823.523	0,10	USD 65.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,25% 15/4/2030	45.765	0,00
USD 1.144.000	OT Merger 7,875% 15/10/2029	758.112	0,04	USD 70.000	Realogy / Realogy Co-Issuer 5,75% 15/1/2029	50.740	0,00
USD 1.689.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,25% 15/1/2029	1.387.124	0,07	USD 3.829.000	Regal Rexnord 6,05% 15/4/2028	3.790.537	0,20
USD 355.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,625% 15/3/2030	288.880	0,01	USD 1.260.000	Regal Rexnord 6,3% 15/2/2030	1.254.287	0,07
USD 2.779.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	2.517.913	0,14	USD 1.305.000	Regal Rexnord 6,4% 15/4/2033	1.293.394	0,07
USD 231.000	Owens-Brockway Glass Container 6,625% 13/5/2027	228.866	0,01	USD 508.000	RegionalCare Hospital Partners / LifePoint Health 9,75% 1/12/2026	473.855	0,02
USD 1.376.000	Owens-Brockway Glass Container 7,25% 15/5/2031	1.383.497	0,07	USD 445.000	Resideo Funding 4% 1/9/2029	372.556	0,02
USD 1.430.000	Pacific Gas and Electric 6,1% 15/1/2029	1.412.741	0,08	USD 1.466.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,5% 15/2/2029	1.283.823	0,07
USD 2.110.000	Pacific Gas and Electric 6,4% 15/6/2033	2.088.404	0,11	USD 2.217.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	2.058.425	0,11
USD 447.000	Pacific Gas and Electric 6,75% 15/1/2053	434.540	0,02	USD 1.929.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 7,25% 15/7/2028	1.940.381	0,10
USD 1.592.000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4,5% 15/8/2028	1.453.698	0,08	USD 485.000	Ritchie Bros 6,75% 15/3/2028	488.918	0,03
				USD 1.250.000	RLJ Lodging Trust 3,75% 1/7/2026	1.146.437	0,06
				USD 374.000	RLJ Lodging Trust 4% 15/9/2029	313.207	0,02
				USD 2.334.000	Rockcliff Energy II 5,5% 15/10/2029	2.151.861	0,11
				USD 5.888.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	5.238.848	0,28

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 516.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3,875% 1/3/2031	418.568	0,02	USD 141.000	Southwestern Energy 5,7% 23/1/2025	139.634	0,01
USD 588.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 4% 15/10/2033	465.000	0,03	USD 1.972.000	Spectrum Brands 5% 1/10/2029	1.805.064	0,10
USD 380.000	Rockies Express Pipeline 4,95% 15/7/2029	348.567	0,02	USD 3.355.000	SRS Distribution 4,625% 1/7/2028	2.992.681	0,16
USD 1.511.000	Ryan Specialty 4,375% 1/2/2030	1.353.193	0,07	USD 3.108.000	SRS Distribution 6% 1/12/2029	2.660.666	0,14
USD 2.060.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	2.026.857	0,11	USD 5.291.000	SRS Distribution 6,125% 1/7/2029	4.603.475	0,25
USD 273.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	269.210	0,01	USD 4.200.000	SS&C Technologies 5,5% 30/9/2027	4.051.430	0,21
USD 2.459.000	SBA Communications 3,125% 1/2/2029	2.103.712	0,11	USD 921.000	Stagwell Global 5,625% 15/8/2029	770.458	0,04
USD 3.951.000	SBA Communications 3,875% 15/2/2027	3.658.354	0,19	EUR 660.000	Standard Industries 2,25% 21/11/2026	634.665	0,03
USD 2.708.000	Science Applications International 4,875% 1/4/2028	2.495.841	0,13	USD 560.000	Standard Industries 3,375% 15/1/2031	445.375	0,02
USD 715.000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6,625% 1/3/2030	630.916	0,03	USD 1.520.000	Standard Industries 4,375% 15/7/2030	1.295.647	0,07
EUR 100.000	SCIL IV / SCIL USA 8,1% 1/11/2026	108.380	0,00	USD 309.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	284.860	0,02
EUR 104.000	SCIL IV / SCIL USA 9,5% 15/7/2028	114.843	0,01	USD 873.000	Standard Industries 5% 15/2/2027	830.528	0,04
USD 1.077.000	Scotts Miracle-Gro 4% 1/4/2031	853.189	0,05	USD 1.255.000	Staples 7,5% 15/4/2026	1.041.283	0,06
USD 268.000	Scotts Miracle-Gro 4,375% 1/2/2032	210.679	0,01	USD 355.000	Starwood Property Trust 4,375% 15/1/2027	318.465	0,02
USD 796.000	Sealed Air 4% 1/12/2027	727.029	0,04	USD 1.522.000	Starwood Property Trust 5,5% 1/11/2023	1.517.019	0,08
USD 341.000	Sealed Air 5% 15/4/2029	316.180	0,02	USD 1.247.000	Station Casinos 4,5% 15/2/2028	1.116.011	0,06
USD 1.052.000	Sealed Air/Sealed Air US 6,125% 1/2/2028	1.038.949	0,05	USD 910.000	Station Casinos 4,625% 1/12/2031	746.838	0,04
USD 2.530.000	Sensata Technologies 4,375% 15/2/2030	2.239.503	0,12	USD 350.000	Stericycle 3,875% 15/1/2029	305.678	0,02
USD 426.000	Service International 3,375% 15/8/2030	354.666	0,02	USD 686.000	Suburban Propane Partners/ Suburban Energy Finance 5% 1/6/2031	587.414	0,03
USD 1.938.000	Service International 4% 15/5/2031	1.644.916	0,09	USD 386.000	Summit Materials / Summit Materials Finance 5,25% 15/1/2029	358.978	0,02
USD 578.000	Service International 5,125% 1/6/2029	545.487	0,03	USD 334.000	Sunoco / Sunoco Finance 6% 15/4/2027	330.789	0,02
USD 3.479.000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4,625% 1/11/2026	3.256.066	0,17	USD 2.564.000	Surgery Center 6,75% 1/7/2025*	2.564.115	0,14
USD 1.296.000	Simmons Foods/Simmons Prepared Foods/Simmons Pet Food 4,625% 1/3/2029	1.076.994	0,06	USD 1.553.000	Surgery Center 10% 15/4/2027	1.581.653	0,08
USD 4.207.000	Sinclair Television 4,125% 1/12/2030	2.714.327	0,14	USD 3.244.000	SWF Escrow Issuer 6,5% 1/10/2029*	2.093.255	0,11
USD 2.203.000	Sirius XM Radio 3,125% 1/9/2026	1.978.771	0,10	USD 1.455.000	Synaptics 4% 15/6/2029	1.233.434	0,07
USD 4.303.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	3.973.433	0,21	USD 797.000	Talen Energy Supply 8,625% 1/6/2030	829.909	0,05
USD 3.721.000	Six Flags Entertainment 7,25% 15/5/2031	3.577.838	0,19	USD 222.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5,5% 15/1/2028	205.896	0,01
USD 1.254.000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	1.254.811	0,07	USD 368.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	352.163	0,02
USD 1.548.000	SLM 3,125% 2/11/2026	1.379.191	0,07	USD 252.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 31/12/2030	226.018	0,01
USD 1.164.000	SM Energy 5,625% 1/6/2025	1.146.492	0,06	USD 1.097.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/9/2031	969.474	0,05
USD 1.367.000	SM Energy 6,5% 15/7/2028	1.334.055	0,07	USD 83.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7,5% 1/10/2025	83.204	0,00
USD 187.000	SM Energy 6,625% 15/1/2027	185.620	0,01	USD 963.000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 4% 15/1/2032	831.749	0,04
USD 1.782.000	SM Energy 6,75% 15/9/2026	1.773.856	0,09	USD 305.000	Taylor Morrison Communities 5,125% 1/8/2030	280.196	0,01
USD 3.297.000	Smyrna Ready Mix Concrete 6% 1/11/2028	3.164.752	0,17	USD 1.890.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	1.858.909	0,10
USD 5.700.000	Sotheby's 7,375% 15/10/2027*	5.191.443	0,28	USD 285.000	TEGNA 4,75% 15/3/2026	271.790	0,01
USD 2.795.000	Sotheby's/Bidfair 5,875% 1/6/2029	2.161.718	0,12	USD 744.000	Teleflex 4,25% 1/6/2028	685.088	0,04
USD 5.000	Southwestern Energy 4,75% 1/2/2032	4.440	0,00				
USD 1.553.000	Southwestern Energy 5,375% 1/2/2029	1.475.763	0,08				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 308.000	Teleflex 4,625% 15/11/2027	289.157	0,02	USD 1.145.000	Univision Communications 5,125% 15/2/2025*	1.126.498	0,06
USD 3.221.000	Tempo Acquisition / Tempo Acquisition Finance 5,75% 1/6/2025	3.169.496	0,17	USD 366.000	Univision Communications 6,625% 1/6/2027	355.409	0,02
USD 738.000	Tempur Sealy International 3,875% 15/10/2031	594.194	0,03	USD 613.000	Univision Communications 7,375% 30/6/2030*	595.815	0,03
USD 635.000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029*	547.687	0,03	USD 1.986.000	Univision Communications 8% 15/8/2028	1.988.937	0,11
USD 566.000	Tenet Healthcare 4,625% 15/6/2028	521.621	0,03	USD 306.000	US Foods 4,625% 1/6/2030	272.141	0,01
USD 2.176.000	Tenet Healthcare 4,875% 1/1/2026	2.111.057	0,11	USD 1.049.000	US Foods 4,75% 15/2/2029	957.139	0,05
USD 964.000	Tenet Healthcare 5,125% 1/11/2027	918.989	0,05	USD 1.089.000	US Foods 6,25% 15/4/2025	1.092.100	0,06
USD 496.000	Tenet Healthcare 6,125% 1/10/2028*	477.978	0,03	USD 6.205.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/4/2026	6.145.528	0,32
USD 1.148.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	1.113.277	0,06	USD 2.688.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/9/2027	2.623.548	0,14
USD 1.405.000	Tenet Healthcare 6,25% 1/2/2027	1.385.978	0,07	USD 1.166.000	Vail Resorts 6,25% 15/5/2025	1.163.321	0,06
USD 6.546.000	Tenet Healthcare 6,75% 15/5/2031	6.531.114	0,35	USD 4.985.000	Venture Global Calcasieu Pass 3,875% 15/8/2029	4.316.215	0,23
USD 1.189.000	Tenneco 8% 17/11/2028	978.381	0,05	USD 1.788.000	Venture Global Calcasieu Pass 3,875% 1/11/2033	1.454.985	0,08
USD 2.436.000	Terex 5% 15/5/2029	2.238.867	0,12	USD 4.944.000	Venture Global Calcasieu Pass 4,125% 15/8/2031	4.198.503	0,23
USD 340.000	TerraForm Power Operating 5% 31/1/2028	309.182	0,02	USD 7.746.000	Venture Global LNG 8,125% 1/6/2028	7.806.984	0,41
USD 614.000	Titan International 7% 30/4/2028	585.245	0,03	USD 11.870.000	Venture Global LNG 8,375% 1/6/2031	11.977.008	0,63
USD 9.914.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	9.340.311	0,50	USD 1.900.000	Veritas US / Veritas Bermuda 7,5% 1/9/2025	1.559.911	0,08
USD 561.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	534.903	0,03	USD 13.913.000	Verscend Escrow 9,75% 15/8/2026	13.837.905	0,73
USD 461.000	Tri Pointe Homes 5,7% 15/6/2028	436.225	0,02	USD 3.275.000	Vertiv 4,125% 15/11/2028	2.943.480	0,16
USD 627.000	Trident TPI 12,75% 31/12/2028	653.015	0,03	USD 1.629.000	Viavi Solutions 3,75% 1/10/2029	1.358.570	0,07
USD 5.306.000	Triumph 9% 15/3/2028	5.326.280	0,28	USD 1.428.000	VICI Properties 4,95% 15/2/2030	1.344.512	0,07
USD 1.076.000	TTMT Escrow Issuer 8,625% 30/9/2027	1.110.264	0,06	USD 1.469.000	VICI Properties 5,625% 15/5/2052	1.294.157	0,07
USD 869.000	Twilio 3,625% 15/3/2029	747.019	0,04	USD 382.000	VICI Properties / VICI Note 3,875% 15/2/2029	336.253	0,02
USD 2.204.000	Twilio 3,875% 15/3/2031	1.853.800	0,10	USD 1.847.000	VICI Properties / VICI Note 4,125% 15/8/2030	1.617.950	0,09
USD 3.259.000	Uber Technologies 0% 15/12/2025	3.050.893	0,16	USD 551.000	VICI Properties / VICI Note 4,5% 15/1/2028	511.816	0,03
USD 6.344.000	Uber Technologies 4,5% 15/8/2029	5.824.103	0,31	USD 3.612.000	VICI Properties / VICI Note 4,625% 1/12/2029	3.262.170	0,17
USD 853.000	Uber Technologies 6,25% 15/1/2028	845.327	0,04	USD 1.992.000	Wabash National 4,5% 15/10/2028	1.690.814	0,09
USD 3.223.000	Uber Technologies 7,5% 15/5/2025	3.254.639	0,17	USD 4.582.000	Warnermedia 5,141% 15/3/2052	3.658.755	0,19
USD 3.301.000	Uber Technologies 7,5% 15/9/2027	3.364.822	0,18	USD 525.000	Warnermedia 5,391% 15/3/2062	417.075	0,02
USD 1.068.000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	1.088.222	0,06	USD 7.549.000	Waste Pro USA 5,5% 15/2/2026	7.123.463	0,38
EUR 237.000	UGI International 2,5% 1/12/2029*	201.162	0,01	USD 1.926.000	Wells Fargo 5,557% 25/7/2034	1.902.352	0,10
USD 2.805.000	United Airlines 4,375% 15/4/2026	2.642.733	0,14	USD 4.590.000	WESCO Distribution 7,125% 15/6/2025	4.613.850	0,24
USD 3.284.000	United Airlines 4,625% 15/4/2029	2.924.131	0,15	USD 2.068.000	WESCO Distribution 7,25% 15/6/2028	2.099.302	0,11
USD 3.385.488	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027	3.381.073	0,18	USD 3.149.000	Western Midstream Operating 5,25% 1/2/2050	2.556.358	0,14
USD 345.877	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026	332.907	0,02	USD 1.022.000	Western Midstream Operating 5,45% 1/4/2044	858.974	0,05
USD 637.000	United Natural Foods 6,75% 15/10/2028	530.959	0,03	USD 849.000	Western Midstream Operating 5,5% 15/8/2048	704.296	0,04
USD 10.766.000	United Rentals North America 6% 15/12/2029	10.712.362	0,57	USD 9.526.000	White Cap Buyer 6,875% 15/10/2028	8.741.582	0,46
USD 4.561.000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	4.545.962	0,24	USD 2.289.000	White Cap Parent 8,25% 15/3/2026*	2.244.404	0,12
				USD 895.000	William Carter 5,625% 15/3/2027	868.459	0,05

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net																																																																																																				
USD 1.700.000	Williams Scotsman International 4,625% 15/8/2028	1.547.225	0,08	<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="2">Royaume-Uni</th> <th>Valeur de marché (USD)</th> <th>% de l'actif net</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>3.743</td> <td>New Topco**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <th colspan="2">États-Unis</th> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>2.388</td> <td>Alliant**</td> <td>2.264.040</td> <td>0,12</td> </tr> <tr> <td>315.073</td> <td>AMP PIPE**</td> <td>1.124.811</td> <td>0,06</td> </tr> <tr> <td>974</td> <td>Archibald Candy**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>8.000</td> <td>Australis Media (Wts 15/5/2003)**,**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>65.370</td> <td>Critical Care Systems International**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>26</td> <td>IssuerCo-U**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>240.000</td> <td>Southern Energy Homes**,**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>1.368</td> <td>Verscend Intermediate**</td> <td>1.793.967</td> <td>0,09</td> </tr> <tr> <td colspan="2">Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants</td> <td>5.182.818</td> <td>0,27</td> </tr> <tr> <th colspan="4">OBLIGATIONS</th> </tr> <tr> <th colspan="2">États-Unis</th> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>USD 197.801</td> <td>Archibald Candy 10% 31/12/2049**,**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>USD 4.000.000</td> <td>Consolidated Hydro 0% 31/12/2049**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>USD 850.000</td> <td>Erscrew Adelpia 0% 31/12/2049**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>USD 290.000</td> <td>Mirant Escrow 0% 15/7/2049**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>USD 115.000</td> <td>Tropicana Entertainment / Tropicana Finance 9,625% 15/12/2014**,**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>USD 4.000.000</td> <td>Wheeling Pittsburgh Steel Escrow 0% 31/12/2049**</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td colspan="2">Total des obligations</td> <td>-</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td colspan="2">Total des autres valeurs mobilières</td> <td>5.185.888</td> <td>0,27</td> </tr> <tr> <td colspan="2">Total du portefeuille</td> <td>1.815.084.542</td> <td>96,25</td> </tr> <tr> <td colspan="2">Autres éléments de l'actif net</td> <td>70.803.202</td> <td>3,75</td> </tr> <tr> <td colspan="2">Total de l'actif net (USD)</td> <td>1.885.887.744</td> <td>100,00</td> </tr> </tbody> </table>				Royaume-Uni		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	3.743	New Topco**	-	0,00	États-Unis				2.388	Alliant**	2.264.040	0,12	315.073	AMP PIPE**	1.124.811	0,06	974	Archibald Candy**	-	0,00	8.000	Australis Media (Wts 15/5/2003)**,**	-	0,00	65.370	Critical Care Systems International**	-	0,00	26	IssuerCo-U**	-	0,00	240.000	Southern Energy Homes**,**	-	0,00	1.368	Verscend Intermediate**	1.793.967	0,09	Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants		5.182.818	0,27	OBLIGATIONS				États-Unis				USD 197.801	Archibald Candy 10% 31/12/2049**,**	-	0,00	USD 4.000.000	Consolidated Hydro 0% 31/12/2049**	-	0,00	USD 850.000	Erscrew Adelpia 0% 31/12/2049**	-	0,00	USD 290.000	Mirant Escrow 0% 15/7/2049**	-	0,00	USD 115.000	Tropicana Entertainment / Tropicana Finance 9,625% 15/12/2014**,**	-	0,00	USD 4.000.000	Wheeling Pittsburgh Steel Escrow 0% 31/12/2049**	-	0,00	Total des obligations		-	0,00	Total des autres valeurs mobilières		5.185.888	0,27	Total du portefeuille		1.815.084.542	96,25	Autres éléments de l'actif net		70.803.202	3,75	Total de l'actif net (USD)		1.885.887.744	100,00
Royaume-Uni		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net																																																																																																								
3.743	New Topco**	-	0,00																																																																																																								
États-Unis																																																																																																											
2.388	Alliant**	2.264.040	0,12																																																																																																								
315.073	AMP PIPE**	1.124.811	0,06																																																																																																								
974	Archibald Candy**	-	0,00																																																																																																								
8.000	Australis Media (Wts 15/5/2003)**,**	-	0,00																																																																																																								
65.370	Critical Care Systems International**	-	0,00																																																																																																								
26	IssuerCo-U**	-	0,00																																																																																																								
240.000	Southern Energy Homes**,**	-	0,00																																																																																																								
1.368	Verscend Intermediate**	1.793.967	0,09																																																																																																								
Total des actions ordinaires / privilégiées et warrants		5.182.818	0,27																																																																																																								
OBLIGATIONS																																																																																																											
États-Unis																																																																																																											
USD 197.801	Archibald Candy 10% 31/12/2049**,**	-	0,00																																																																																																								
USD 4.000.000	Consolidated Hydro 0% 31/12/2049**	-	0,00																																																																																																								
USD 850.000	Erscrew Adelpia 0% 31/12/2049**	-	0,00																																																																																																								
USD 290.000	Mirant Escrow 0% 15/7/2049**	-	0,00																																																																																																								
USD 115.000	Tropicana Entertainment / Tropicana Finance 9,625% 15/12/2014**,**	-	0,00																																																																																																								
USD 4.000.000	Wheeling Pittsburgh Steel Escrow 0% 31/12/2049**	-	0,00																																																																																																								
Total des obligations		-	0,00																																																																																																								
Total des autres valeurs mobilières		5.185.888	0,27																																																																																																								
Total du portefeuille		1.815.084.542	96,25																																																																																																								
Autres éléments de l'actif net		70.803.202	3,75																																																																																																								
Total de l'actif net (USD)		1.885.887.744	100,00																																																																																																								
USD 1.712.000	Williams Scotsman International 6,125% 15/6/2025	1.697.769	0,09																																																																																																								
USD 812.000	WR Grace 4,875% 15/6/2027	758.319	0,04																																																																																																								
USD 5.708.000	WR Grace 5,625% 15/8/2029	4.803.682	0,25																																																																																																								
USD 1.345.000	WR Grace 7,375% 1/3/2031	1.329.151	0,07																																																																																																								
USD 1.059.000	Wyndham Hotels & Resorts 4,375% 15/8/2028	969.603	0,05																																																																																																								
USD 2.100.000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5,25% 15/5/2027	1.987.206	0,11																																																																																																								
USD 3.651.000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5,125% 1/10/2029	3.272.189	0,18																																																																																																								
USD 1.930.000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7,125% 15/2/2031	1.895.802	0,10																																																																																																								
USD 595.000	XPO Escrow Sub 7,5% 15/11/2027	605.608	0,03																																																																																																								
USD 20.998.000	Zayo 4% 1/3/2027*	15.790.653	0,84																																																																																																								
USD 5.182.000	Zayo 6,125% 1/3/2028	3.371.058	0,18																																																																																																								
USD 4.729.000	ZoomInfo Technologies/ ZoomInfo Finance 3,875% 1/2/2029*	4.024.244	0,21																																																																																																								
Total des obligations		1.376.399.661	72,97																																																																																																								
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		1.778.928.736	94,33																																																																																																								
Autres titres négociables																																																																																																											
ACTIONS ORDINAIRES / PRIVILEGIEES ET WARRANTS																																																																																																											
Bermudes																																																																																																											
22.200	Loral Space & Communications (Wts 26/12/2006)**,**	-	0,00																																																																																																								
Luxembourg																																																																																																											
5.660	ADLER**	3.070	0,00																																																																																																								

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	3.621.000	USD	4.038.680	Morgan Stanley	20/9/2023	(107.049)
GBP	166.000	USD	213.481	JP Morgan	20/9/2023	(3.036)
USD	157.616	EUR	146.000	RBS	20/9/2023	(909)
USD	506.765	GBP	400.000	State Street	20/9/2023	(331)
USD	8.009.183	GBP	6.246.000	BNP Paribas	20/9/2023	90.865
USD	83.792.623	EUR	76.357.000	BNP Paribas	20/9/2023	885.266
USD	1.201.316	EUR	1.090.000	State Street	20/9/2023	17.809
USD	109.739	EUR	100.000	Deutsche Bank	20/9/2023	1.161
USD	175.006	EUR	159.000	Morgan Stanley	20/9/2023	2.366
USD	31.881	EUR	29.000	Société Générale	20/9/2023	393
USD	303.573	EUR	278.000	Citigroup	20/9/2023	1.725
USD	266.248	EUR	241.000	BNY Mellon	20/9/2023	4.573
USD	97.531	EUR	88.000	UBS	20/9/2023	1.981

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
USD	430.618	GBP	337.000	Morgan Stanley	20/9/2023	3.388
USD	838.416	GBP	655.000	BNY Mellon	20/9/2023	8.046
Plus-value nette non réalisée						906.248
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	78.370.982	USD	51.038.029	BNY Mellon	15/9/2023	(252.440)
USD	666.856	AUD	1.037.753	BNY Mellon	15/9/2023	(5.620)
Moins-value nette non réalisée						(258.060)
Catégorie d'Actions couverte en CAD						
CAD	5.928.904	USD	4.408.670	BNY Mellon	15/9/2023	(25.419)
USD	68.123	CAD	92.207	BNY Mellon	15/9/2023	(46)
Moins-value nette non réalisée						(25.465)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	3.563.869	USD	4.080.976	BNY Mellon	15/9/2023	(40.965)
USD	27.240	CHF	23.911	BNY Mellon	15/9/2023	134
Moins-value nette non réalisée						(40.831)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	8.811.689	USD	1.220.809	BNY Mellon	15/9/2023	(8.944)
USD	7.100	CNY	51.826	BNY Mellon	15/9/2023	(28)
Moins-value nette non réalisée						(8.972)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	37.485.017	USD	41.078.668	BNY Mellon	15/9/2023	(387.606)
USD	5.117.526	EUR	4.687.905	BNY Mellon	15/9/2023	28.682
Moins-value nette non réalisée						(358.924)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	16.189.753	USD	20.598.625	BNY Mellon	15/9/2023	(74.654)
USD	160.679	GBP	126.110	BNY Mellon	15/9/2023	808
Moins-value nette non réalisée						(73.846)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	184.734.573	USD	23.669.698	BNY Mellon	15/9/2023	(102.861)
USD	286.518	HKD	2.242.782	BNY Mellon	15/9/2023	405
Moins-value nette non réalisée						(102.456)
Catégorie d'Actions couverte en NZD						
NZD	3.009.389	USD	1.817.962	BNY Mellon	15/9/2023	(28.082)
USD	13.862	NZD	23.397	BNY Mellon	15/9/2023	(53)
Moins-value nette non réalisée						(28.135)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	1.078	SGD	1.460	BNY Mellon	5/9/2023	(2)
SGD	25.745.813	USD	19.126.549	BNY Mellon	15/9/2023	(70.206)
USD	1.281.532	SGD	1.736.923	BNY Mellon	15/9/2023	(4.088)
Moins-value nette non réalisée						(74.296)
Catégorie d'Actions couverte en ZAR						
USD	71.147	ZAR	1.356.297	BNY Mellon	15/9/2023	(966)
ZAR	118.613.531	USD	6.289.413	BNY Mellon	15/9/2023	17.079
Plus-value nette non réalisée						16.113
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 278.941.292)						(48.624)

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(4)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	486.250	(6.062)
(31)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	4.013.531	(53.658)
89	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	9.505.617	58.840
Total				14.005.398	(880)

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	EUR (55.219)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2026	(648)	1.684
CDS	EUR (40.611)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	(100)	(10.071)
CDS	EUR (114.152)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Barclays	20/12/2027	(282)	(28.309)
CDS	EUR (67.564)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	64	(16.755)
CDS	EUR (103.978)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/12/2027	11.164	(4.745)
CDS	EUR (89.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Bank of America	20/6/2026	6.479	4.019
CDS	EUR (33.123)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Citibank	20/12/2027	157	(8.214)
CDS	EUR (78.946)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(1.119)	2.407
CDS	EUR (135.000)	Fund provides default protection on Jaguar Land Rover; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/12/2026	(1.464)	4.116
CDS	EUR (190.000)	Fund provides default protection on CMA CGM; and receives Fixed 5%	Credit Suisse	20/6/2027	13.578	22.472
CDS	EUR 88.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	203	18.824
CDS	EUR 88.000	Fund receives default protection on Intrum Justitia; and pays Fixed 5%	HSBC Bank	20/6/2028	(61)	18.824
CDS	EUR (170.000)	Fund provides default protection on K And S 500; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2026	7.683	22.265
CDS	EUR (230.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes Finance; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	35.450	(5.022)
CDS	EUR (90.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	8.209	(1.965)
CDS	EUR (100.000)	Fund provides default protection on Ladbrokes; and receives Fixed 1%	JP Morgan	20/6/2027	12.853	(2.184)
CDS	EUR (70.022)	Fund provides default protection on United; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2027	8.280	(3.196)
CDS	EUR 50.144	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(296)	74
CDS	EUR 62.856	Fund receives default protection on Euro Garages; and pays Fixed 5%	JP Morgan	20/6/2028	(448)	93
CDS	EUR (120.000)	Fund provides default protection on Virgin Media Finance; and receives Fixed 5%	JP Morgan	20/12/2025	(8.762)	6.988
CDS	EUR (50.260)	Fund provides default protection on Adler Real Estate 500; and receives Fixed 5%	Morgan Stanley	20/12/2027	(76)	(12.464)
CDS	USD (18.577.272)	Fund provides default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and receives Fixed 5%	Goldman Sachs	20/6/2028	469.275	549.667
TRS	USD 8.198.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	JP Morgan	20/12/2023	215.407	190.112
TRS	USD 2.275.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	JP Morgan	20/3/2024	53.102	35.813
TRS	USD 525.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/3/2024	14.042	11.687
TRS	USD 1.049.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/3/2024	32.931	27.972
TRS	USD 2.099.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/3/2024	89.712	77.061

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar High Yield Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
TRS	USD 7.609.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/3/2024	179.381	121.556
TRS	USD 11.528.000	Fund receives Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bps; and pays USD SOFR 1 Day + 0bps	Morgan Stanley	20/3/2024	309.841	220.769
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 55.103.847)					1.454.555	1.243.478

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

TRS : Swaps sur rendement total (Total Return Swaps)

Options achetées au 31 août 2023

Nombre de contrats	Achat/ vente	Description	Contrepartie	Prix d'exercice	Date d'expiration	Moins-value non réalisée USD	Valeur de marché USD
333	Put	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/9/2023	(183.360)	8.159
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 499.028)						(183.360)	8.159

US Dollar Reserve Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
OBLIGATIONS							
États-Unis							
USD 1.360.000	Toyota Motor Credit 5,692% 22/2/2024	1.360.477	0,26	USD 11.000.000	Allemagne Bayerische Landesbank 0% 1/9/2023	10.996.783	2,14
USD 8.000.000	United States Treasury Floating Rate Note 5,398% 31/1/2024	8.000.935	1,56	USD 4.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0% 5/2/2024	3.902.727	0,76
		9.361.412	1,82	USD 2.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0% 2/5/2024	1.924.888	0,37
Total des obligations		9.361.412	1,82			16.824.398	3,27
BILLET DE TRÉSORERIE							
Australie				Pays-Bas			
USD 4.000.000	ANZ 0% 8/11/2023	3.958.428	0,77	USD 12.000.000	BNG Bank 0% 18/9/2023	11.966.275	2,33
USD 1.500.000	Australia & New Zealand Banking 0% 30/7/2024	1.423.625	0,28	USD 7.000.000	BNG Bank 0% 21/9/2023	6.977.199	1,36
USD 1.000.000	Australia & New Zealand Banking 5,81% 2/4/2024	1.000.610	0,19	USD 2.000.000	Cooperatieve Rabobank UA 0% 1/12/2023	1.972.349	0,38
USD 2.000.000	Commonwealth Bank of Australia 5,4% 16/2/2024	1.997.886	0,39			20.915.823	4,07
USD 1.000.000	Commonwealth Bank of Australia 5,8% 18/3/2024	1.000.674	0,19	Nouvelle-Zélande			
USD 2.500.000	Macquarie Bank 0% 23/10/2023	2.479.544	0,48	USD 2.000.000	ANZ New Zealand Int'l 0% 9/11/2023	1.978.913	0,38
USD 975.000	Macquarie Bank 0% 6/11/2023	964.858	0,19	USD 2.800.000	BNZ International Funding 5,688% 27/10/2023	2.801.132	0,55
USD 2.000.000	Macquarie Bank 0% 12/2/2024	1.947.922	0,38			4.780.045	0,93
USD 3.000.000	Macquarie Bank 5,68% 16/2/2024	2.999.940	0,58	Norvège			
USD 3.500.000	Macquarie Bank 5,72% 16/1/2024	3.500.940	0,68	USD 1.000.000	DNB Bank 0% 30/7/2024	947.945	0,18
USD 2.500.000	National Australia Bank 5,79% 2/2/2024	2.501.703	0,49	USD 1.250.000	DNB Bank 5,78% 29/4/2024	1.250.701	0,24
USD 2.000.000	National Australia Bank 5,8% 8/4/2024	2.001.315	0,39			2.198.646	0,42
USD 2.000.000	National Australia Bank 5,8% 12/4/2024	2.001.650	0,39	Suède			
USD 4.000.000	Suncorp-Metway 0% 6/9/2023	3.995.609	0,78	USD 1.000.000	Svenska Handelsbanken 0% 12/12/2023	984.319	0,19
USD 1.500.000	Westpac Banking 0% 13/3/2024	1.454.585	0,28	USD 2.000.000	Swedbank 5,58% 1/9/2023	2.000.022	0,39
USD 1.500.000	Westpac Banking 5,8% 19/4/2024	1.500.895	0,29			2.984.341	0,58
USD 1.000.000	Westpac Banking 5,82% 19/4/2024	1.000.723	0,19	Suisse			
		35.730.907	6,94	USD 1.250.000	UBS 5,624% 26/9/2023	1.250.445	0,24
Canada				Royaume-Uni			
USD 7.000.000	CDP Financial 0% 12/9/2023	6.986.552	1,36	USD 7.000.000	Bedford Row Funding 0% 6/9/2023	6.992.752	1,36
USD 4.000.000	CDP Financial 0% 4/12/2023	3.941.803	0,77	USD 1.250.000	HSBC Bank 5,72% 26/1/2024	1.250.308	0,24
USD 2.000.000	CDP Financial 5,66% 8/1/2024	2.000.126	0,39	USD 4.000.000	Lloyds Bank 0% 10/10/2023	3.975.218	0,77
USD 10.000.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 0% 15/9/2023	9.976.298	1,94	USD 12.000.000	Nationwide Building Society 0% 5/9/2023	11.989.336	2,33
USD 1.421.000	National Bank of Canada (New York Branch) 0% 23/2/2024	1.382.008	0,27			24.207.614	4,70
USD 2.000.000	Ontario Teachers Finance Trust 0% 6/5/2024	1.923.056	0,37	États-Unis			
USD 4.000.000	Podium Funding 0% 6/11/2023	3.958.958	0,77	USD 4.000.000	Alinghi Funding 0% 9/1/2024	3.918.233	0,76
USD 3.000.000	Podium Funding 0% 16/1/2024	2.935.226	0,57	USD 8.300.000	Archer-Daniels-Midland 0% 11/9/2023	8.285.367	1,61
USD 2.000.000	Royal Bank of Canada (New York Branch) 5,9% 23/5/2024	2.002.506	0,39	USD 3.000.000	Britannia Funding 0% 10/10/2023	2.981.506	0,58
		35.106.533	6,83	USD 3.000.000	Columbia Funding 0% 12/9/2023	2.994.212	0,58
France				USD 2.000.000	Columbia Funding 0% 1/2/2024	1.951.408	0,38
USD 1.500.000	BPCE 0% 1/9/2023	1.499.557	0,29	USD 4.000.000	Concord Minutemen Capital 5,65% 7/12/2023	4.001.063	0,78
USD 3.000.000	BPCE 0% 7/2/2024	2.924.196	0,57	USD 2.500.000	Credit Industriel et Commercial 0% 9/2/2024	2.435.739	0,47
USD 5.000.000	BPCE 5,67% 31/10/2023	5.001.621	0,97	USD 12.000.000	Credit Industriel et Commercial (New York Branch) 5,44% 1/9/2023	12.000.006	2,33
USD 2.000.000	Natixis (New York Branch) 0% 7/2/2024	1.949.849	0,38	USD 1.000.000	FMS Wertmanagement 0% 2/5/2024	962.902	0,19
		11.375.223	2,21	USD 1.000.000	FMS Wertmanagement 0% 3/5/2024	962.744	0,19
				USD 2.000.000	Gotham Funding 0% 2/11/2023	1.980.555	0,39
				USD 9.700.000	ING US Funding 0% 16/10/2023	9.631.628	1,87
				USD 1.750.000	ING US Funding 0% 8/11/2023	1.731.506	0,34
				USD 5.000.000	ING US Funding 5,45% 5/9/2023	5.000.042	0,97
				USD 4.000.000	Starbird Funding 5,63% 10/11/2023	4.000.820	0,78
						62.837.731	12,22
				Total des billets de trésorerie		218.211.706	42,41

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Reserve Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	
CERTIFICATS DE DÉPÔT				USD 3.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank/ New York 5,62% 8/9/2023	3.000.165	0,58	
USD 1.000.000	Canada Bank of Nova Scotia/Houston 5,79% 26/1/2024	1.000.727	0,19	USD 2.330.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank/ New York 5,62% 5/10/2023	2.330.412	0,45	
USD 2.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 5,4% 8/2/2024	1.996.750	0,39	USD 3.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank/ New York 5,72% 29/1/2024	3.000.959	0,58	
USD 2.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 5,6% 1/12/2023	2.000.276	0,39			47.835.764	9,30	
USD 2.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 5,6% 4/3/2024	1.997.231	0,39	Corée du Sud				
USD 2.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 5,93% 28/6/2024	2.000.001	0,39	USD 1.000.000	Korea Development Bank/The (New York Branch) 5,82% 16/2/2024	1.000.013	0,19	
USD 2.000.000	Royal Bank of Canada/New York NY 6,1% 19/10/2023	2.001.569	0,39	Suède				
USD 1.500.000	Toronto Dominion Bank (New York Branch) 0% 29/1/2024	1.500.953	0,29	USD 1.500.000	Svenska Handelsbanken/New York NY 5,85% 29/4/2024	1.501.473	0,29	
USD 2.000.000	Toronto Dominion Bank (New York Branch) 5,27% 24/1/2024	1.995.271	0,39	Royaume-Uni				
		14.492.778	2,82	USD 2.500.000	Standard Chartered Bank (New York Branch) 5,21% 31/10/2023	2.498.627	0,48	
	Finlande			USD 2.000.000	Standard Chartered Bank (New York Branch) 5,63% 1/3/2024	1.995.563	0,39	
USD 2.000.000	Nordea Bank 5,82% 18/4/2024	2.001.390	0,39			4.494.190	0,87	
	France			États-Unis				
USD 2.000.000	BNP Paribas 5,93% 5/2/2024	2.002.435	0,39	USD 2.500.000	Bank of America 0% 15/9/2023	2.500.175	0,49	
USD 2.000.000	BNP Paribas (New York Branch) 5,25% 31/1/2024	1.994.697	0,39	USD 1.500.000	Bank of America 0% 14/12/2023	1.500.162	0,29	
USD 1.000.000	Credit Agricole 5,69% 13/12/2023	1.000.251	0,19	USD 2.500.000	Bank of America 5,25% 31/1/2024	2.493.502	0,48	
USD 2.000.000	Credit Agricole Corporate and Investment Bank/New York 5,68% 17/11/2023	2.001.174	0,39	USD 1.839.000	Bank of America 5,44% 6/2/2024	1.835.290	0,36	
USD 2.000.000	Natixis (New York Branch) 5,22% 13/10/2023	1.999.233	0,39	USD 4.000.000	Bank of America 5,53% 15/9/2023	4.000.091	0,78	
		8.997.790	1,75	USD 2.500.000	Bank of America 5,75% 9/1/2024	2.500.119	0,48	
	Allemagne			USD 1.500.000	Citibank 5,92% 21/9/2023	1.500.471	0,29	
USD 1.500.000	DG Bank (New York Branch) 5,4% 9/11/2023	1.499.443	0,29	USD 2.000.000	Citibank (New York Branch) 4,16% 1/9/2023	1.999.846	0,39	
	Japon			USD 725.000	Citibank (New York Branch) 5,8% 26/2/2024	724.919	0,14	
USD 2.500.000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking 5,7% 14/2/2024	2.500.222	0,49	USD 2.000.000	Citibank (New York Branch) 5,8% 4/3/2024	1.999.044	0,39	
USD 6.000.000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking (New York Branch) 5,33% 5/9/2023	5.999.997	1,17	USD 1.500.000	Citibank (New York Branch) 5,8% 18/3/2024	1.499.706	0,29	
USD 2.500.000	Mizuho Bank 5,65% 20/10/2023	2.500.607	0,49	USD 1.000.000	Citibank (New York Branch) 5,89% 10/5/2024	999.978	0,19	
USD 3.000.000	Mizuho Bank 5,71% 20/2/2024	3.000.438	0,58	USD 2.500.000	State Street Bank & Trust 5,8% 28/3/2024	2.501.276	0,49	
USD 4.000.000	Mizuho Bank (New York Branch) 5,39% 1/9/2023	4.000.008	0,78	USD 2.500.000	Wells Fargo Bank 5,8% 22/1/2024	2.501.846	0,49	
USD 4.000.000	MUFG Bank (New York Branch) 5,62% 1/11/2023	4.001.266	0,78	USD 1.000.000	Wells Fargo Bank 5,94% 17/7/2024	1.000.715	0,19	
USD 5.000.000	Sumitomo Mitsui Banking 5,45% 8/9/2023	5.000.029	0,97			29.557.140	5,74	
USD 3.000.000	Sumitomo Mitsui Banking 5,7% 20/2/2024	3.000.520	0,58	Total des certificats de dépôt			111.379.981	21,64
USD 2.500.000	Sumitomo Mitsui Banking 5,72% 7/2/2024	2.500.815	0,49	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			338.953.099	65,87
USD 4.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank 5,54% 21/9/2023	4.000.311	0,78	Total du portefeuille			338.953.099	65,87
USD 3.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank 5,6% 29/11/2023	3.000.015	0,58	Autres éléments de l'actif net			175.627.077	34,13
				Total de l'actif net (USD)			514.580.176	100,00

US Dollar Reserve Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	15.551.048	USD	19.785.544	BNY Mellon	15/9/2023	(71.268)
USD	104.210	GBP	82.116	BNY Mellon	15/9/2023	110
Moins-value nette non réalisée						(71.158)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 19.816.408)						(71.158)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				USD 2.115.000	OMERS Finance Trust 4% 20/4/2028	2.039.043	0,13
				USD 18.000	Ontario Gaming GTA 8% 1/8/2030	18.220	0,00
				USD 3.985.000	Ontario Teachers' Finance Trust 4,25% 25/4/2028	3.895.393	0,24
				USD 2.000	Precision Drilling 6,875% 15/1/2029	1.903	0,00
				USD 398.000	Rogers Communications 2,9% 15/11/2026	366.675	0,02
				USD 3.587.000	Rogers Communications 3,2% 15/3/2027	3.314.286	0,21
				USD 1.969.000	Royal Bank of Canada 6% 1/11/2027	2.013.365	0,12
				EUR 730.000	Toronto-Dominion Bank/The 0,375% 25/4/2024	773.548	0,05
				USD 3.043.000	Toronto-Dominion Bank/The 5,156% 10/1/2028	3.011.370	0,19
				USD 58.000	Videotron 5,125% 15/4/2027	55.587	0,00
						30.697.765	1,90
OBLIGATIONS				Îles Caimans			
	Australie			USD 650.000	Allegro CLO II-S 7,745% 21/10/2028	648.702	0,04
USD 379.000	National Australia Bank 4,944% 12/1/2028	375.966	0,02	USD 2.000.000	Allegro CLO IV 7,12% 15/1/2030	1.981.644	0,12
USD 5.165.000	Westpac Banking 4,184% 22/5/2028*	5.002.199	0,31	USD 550.000	Allegro CLO XI 7,432% 19/1/2033	544.439	0,03
		5.378.165	0,33	USD 3.250.000	Apidos CLO XXIX 7,163% 25/7/2030	3.220.929	0,20
	Belgique			USD 1.421.442	ASSURANT CLO 6,628% 20/4/2031	1.414.962	0,09
EUR 600.000	KBC 0,5% 3/12/2029	610.419	0,04	USD 3.214.336	Bean Creek CLO 6,608% 20/4/2031	3.194.038	0,20
	Bermudes			USD 520.000	Benefit Street Partners CLO V-B 6,678% 20/4/2031	518.099	0,03
USD 221.000	Carnival Bermuda 10,375% 1/5/2028	240.781	0,01	USD 500.000	Canyon CLO 2018-1 6,64% 15/7/2031	498.029	0,03
USD 15.000	NCL 8,375% 1/2/2028	15.465	0,00	USD 1.612.683	Carbone CLO 6,728% 20/1/2031	1.610.667	0,10
USD 73.000	Valaris 8,375% 30/4/2030	74.489	0,01	USD 2.333.392	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 6,71% 15/7/2031	2.327.224	0,14
USD 8.000	Viking Ocean Cruises Ship VII 5,625% 15/2/2029	7.472	0,00	USD 1.250.000	CARLYLE US CLO 2018-4 7,658% 20/1/2031	1.245.131	0,08
USD 19.000	Weatherford International 6,5% 15/9/2028	19.048	0,00	USD 931.069	CIFC Funding 2017-V 6,75% 16/11/2030	930.141	0,06
		357.255	0,02	USD 250.000	CIFC Funding 2018-V 6,76% 15/1/2032	249.596	0,02
	Canada			USD 7.000.000	CIFC Funding 2019-I 6,688% 20/4/2032	6.929.587	0,43
USD 4.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3,875% 15/1/2028	3.643	0,00	USD 713.743	Clear Creek CLO 6,788% 20/10/2030	710.975	0,04
USD 125.000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4,375% 15/1/2028	114.868	0,01	USD 4.543.151	Deer Creek CLO 2017-1 6,768% 20/10/2030	4.524.404	0,28
USD 87.000	Air Canada 3,875% 15/8/2026	80.471	0,01	USD 222.000	Fantasia 10,875% 9/1/2023***	11.100	0,00
USD 3.040.000	Bank of Montreal 5,2% 12/12/2024	3.022.586	0,19	USD 200.000	Fantasia 11,875% 1/6/2023***	10.000	0,00
USD 15.000	Baytex Energy 8,5% 30/4/2030	15.220	0,00	USD 2.150.000	Galaxy XXII CLO 6,77% 16/4/2034	2.121.177	0,13
USD 94.000	Bombardier 6% 15/2/2028	87.870	0,00	USD 5.000	GGAM Finance 7,75% 15/5/2026	5.026	0,00
USD 146.000	Bombardier 7,125% 15/6/2026	143.672	0,01	USD 5.000	GGAM Finance 8% 15/6/2028	5.072	0,00
USD 48.000	Bombardier 7,5% 1/2/2029	47.168	0,00	USD 2.500.000	Goldentree Loan Management US CLO 3 6,888% 20/4/2030	2.457.794	0,15
USD 83.000	Bombardier 7,875% 15/4/2027	82.883	0,01	USD 500.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 6,658% 20/10/2032	497.125	0,03
USD 70.000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	58.398	0,00	USD 929.114	Goldentree Loan Opportunities XI 6,642% 18/1/2031	927.150	0,06
USD 371.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,25% 15/5/2026	367.636	0,02	USD 31.000	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5,75% 20/1/2026	28.702	0,00
USD 5.030.000	CPPIB Capital 0,5% 16/9/2024	4.783.933	0,30				
USD 2.460.000	Enbridge 2,5% 14/2/2025	2.350.379	0,15				
USD 26.000	Enerflex 9% 15/10/2027	25.870	0,00				
USD 53.000	Garda World Security 4,625% 15/2/2027	49.078	0,00				
USD 53.000	Garda World Security 7,75% 15/2/2028	52.921	0,01				
USD 49.000	GFL Environmental 3,5% 1/9/2028	43.381	0,00				
USD 15.000	GFL Environmental 3,75% 1/8/2025	14.307	0,00				
USD 104.000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	93.331	0,01				
USD 2.000	GFL Environmental 4,25% 1/6/2025	1.937	0,00				
USD 61.000	GFL Environmental 5,125% 15/12/2026	59.090	0,00				
USD 25.000	Jones Deslauriers Insurance Management 8,5% 15/3/2030	25.544	0,00				
USD 5.000	Masonite International 5,375% 1/2/2028	4.722	0,00				
USD 10.000	Mattamy 4,625% 1/3/2030	8.830	0,00				
USD 43.000	New Gold 7,5% 15/7/2027	41.064	0,00				
USD 25.000	NOVA Chemicals 4,875% 1/6/2024	24.589	0,00				
USD 3.975.000	OMERS Finance Trust 1,1% 26/3/2026	3.604.984	0,22				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 400.000	LCM Loan Income Fund I Income Note Issuer 6,65% 16/7/2031	399.100	0,02	EUR 475.293	FCT Noria 2021 4,342% 25/10/2049	511.204	0,03
USD 250.000	Marble Point CLO XXII 7,463% 25/7/2034	244.199	0,02	EUR 297.058	FCT Noria 2021 4,742% 25/10/2049	317.014	0,02
USD 232.129	Milos CLO 6,658% 20/10/2030	231.454	0,01	EUR 415.882	FCT Noria 2021 5,142% 25/10/2049	439.910	0,03
USD 500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 25 6,922% 18/10/2029	494.605	0,03	EUR 196.538	FCT Pixel 2021 5,576% 25/2/2038	209.917	0,01
USD 4.743.902	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 6,492% 18/10/2030	4.721.691	0,29	EUR 1.000.000	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 5,134% 27/8/2061	1.081.960	0,07
USD 500.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6,712% 19/10/2031	498.828	0,03	EUR 400.000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 4,734% 27/5/2061	426.844	0,02
USD 300.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 7,282% 19/10/2031	299.026	0,02	USD 362.000	Iliad 6,5% 15/10/2026	345.229	0,02
USD 850.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 6,65% 16/10/2033	846.565	0,05	EUR 800.000	Pernod Ricard 0% 24/10/2023	863.217	0,06
USD 750.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 7,076% 20/1/2035	739.935	0,05	EUR 600.000	Schneider Electric 0,25% 9/9/2024	629.372	0,04
USD 500.225	OCP CLO 2017-14 6,791% 20/11/2030	497.904	0,03	EUR 950.000	WPP Finance 4,125% 30/5/2028	1.031.450	0,06
USD 8.600.000	Peace Park CLO 6,718% 20/10/2034	8.566.307	0,53			7.316.631	0,45
USD 3.920.000	Pikes Peak CLO 1 6,787% 24/7/2031	3.895.243	0,24		Allemagne		
USD 4.016.065	Regatta VIII Funding 6,82% 17/10/2030	4.012.377	0,25	EUR 600.000	Bayer 0,05% 12/1/2025	617.658	0,04
USD 1.000.000	Regatta VIII Funding 7,27% 17/10/2030	1.000.096	0,06	EUR 1.240.000	Bayer 4% 26/8/2026	1.360.420	0,08
USD 250.000	Regatta X Funding 7,02% 17/1/2031	247.375	0,02	EUR 200.000	Commerzbank 0,75% 24/3/2026	204.024	0,01
USD 1.750.000	Regatta XVI Funding 7,62% 15/1/2033	1.745.631	0,11	EUR 290.000	Covestro 0,875% 3/2/2026	294.745	0,02
USD 258.887	Rockford Tower CLO 2017-3 6,778% 20/10/2030	258.563	0,02	EUR 100.000	Deutsche Bank 1% 19/11/2025	103.775	0,01
USD 525.000	RR 19 6,71% 15/10/2035	522.451	0,03	USD 1.310.000	Deutsche Bank 1,447% 1/4/2025	1.268.919	0,08
USD 2.249.457	RR 3 6,66% 15/1/2030	2.245.578	0,14	EUR 210.000	E.ON 0,875% 8/1/2025*	219.207	0,01
USD 77.000	Seagate HDD Cayman 8,25% 15/12/2029	80.908	0,01	EUR 233.723	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,388% 15/9/2030	252.416	0,02
USD 17.000	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	17.052	0,00	EUR 311.630	Red & Black Auto Germany 8 UG 4,588% 15/9/2030	332.749	0,02
USD 1.000.000	Symphony CLO XXIII 7,17% 15/1/2034	988.585	0,06	EUR 1.100.000	Volkswagen Bank 1,875% 31/1/2024	1.181.493	0,07
USD 1.000.000	TICP CLO V 2016-1 7,32% 17/7/2031	997.534	0,06	EUR 600.000	Volkswagen Bank 2,5% 31/7/2026	618.862	0,04
USD 93.100	Transocean 8,75% 15/2/2030	95.674	0,01	EUR 600.000	Volkswagen Bank 4,25% 7/1/2026*	648.799	0,04
USD 21.000	Transocean Titan Financing 8,375% 1/2/2028	21.604	0,00	EUR 520.000	Volkswagen Financial Services 0,875% 31/1/2028	488.161	0,03
USD 900.000	Trinitas CLO XVIII 6,758% 20/1/2035	891.352	0,05	EUR 330.000	Volkswagen Leasing 0,375% 20/7/2026	322.112	0,02
		71.171.350	4,40			7.913.340	0,49
	Finlande				Irlande		
EUR 905.000	CRH Finland Services 0,875% 5/11/2023	976.372	0,06	USD 2.200.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2,45% 29/10/2026	1.979.766	0,12
	France			USD 1.700.000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2,875% 14/8/2024	1.650.202	0,10
USD 326.000	Altice France 8,125% 1/2/2027	275.806	0,02	GBP 799.701	Agora UK 2021 6,37% 22/7/2031	975.726	0,06
EUR 200.000	Arkema 0,125% 14/10/2026	195.598	0,01	GBP 784.347	Atom Mortgage 7,07% 22/7/2031	836.643	0,05
EUR 400.000	Banque Stellantis France SACA 0% 22/1/2025	410.357	0,02	USD 2.000	Castlake Aviation Finance 5% 15/4/2027	1.841	0,00
EUR 400.000	BPCE 0,625% 28/4/2025	410.795	0,03	EUR 500.000	CRH SMW Finance 4% 11/7/2027	545.147	0,04
EUR 77.682	FCT Autonoria 2019 4,492% 25/9/2035	84.257	0,01	EUR 525.000	ESB Finance 3,494% 12/1/2024	568.796	0,03
EUR 77.565	FCT Autonoria 2019 6,342% 25/9/2035	83.701	0,00	GBP 731.147	Frost CMBS 2021-1 6,568% 20/11/2033	905.979	0,06
				EUR 1.050.696	Haus European Loan Conduit No 39 4,364% 28/7/2051	1.074.178	0,07
				EUR 796.770	Haus European Loan Conduit No 39 4,814% 28/7/2051	773.767	0,05
				EUR 636.816	Haus European Loan Conduit No 39 5,114% 28/7/2051	569.790	0,04
				EUR 987.744	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4,537% 17/8/2033	1.027.715	0,06
				EUR 906.253	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,187% 17/8/2033	920.407	0,06
				EUR 320.085	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5,687% 17/8/2033	314.790	0,02

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 1.000.794	Last Mile PE 2021 4,687% 17/8/2031	1.048.493	0,06				
EUR 1.316.724	Last Mile PE 2021 4,837% 17/8/2031	1.356.696	0,08				
EUR 678.857	Last Mile PE 2021 4,987% 17/8/2031	692.149	0,04				
EUR 918.807	Last Mile PE 2021 5,387% 17/8/2031	918.660	0,06				
USD 264.000	LCPR Senior Secured Financing 6,75% 15/10/2027	248.977	0,02				
EUR 500.000	Linde 3,625% 12/6/2025	541.182	0,03				
EUR 2.001.394	Pearl Finance 2020 5,187% 17/11/2032	2.136.334	0,13				
EUR 1.128.144	Pearl Finance 2020 5,687% 17/11/2032	1.198.849	0,07				
EUR 1.354.717	Pearl Finance 2020 6,287% 17/11/2032	1.431.212	0,09				
USD 789.175	Prodigy Finance CM2021-1 6,679% 25/7/2051	783.835	0,05				
EUR 453.550	River Green Finance 2020 4,748% 22/1/2032	466.705	0,03				
EUR 236.425	River Green Finance 2020 5,098% 22/1/2032	242.973	0,01				
EUR 345.330	SCF Rahoituspalvelut IX 4,622% 25/10/2030	372.665	0,02				
USD 950.000	SMBC Aviation Capital Finance 1,9% 15/10/2026	842.963	0,05				
USD 605.000	SMBC Aviation Capital Finance 2,3% 15/6/2028	516.610	0,03				
GBP 321.638	Taurus 2021-1 UK 6,869% 17/5/2031	377.549	0,02				
GBP 262.075	Taurus 2021-1 UK 7,819% 17/5/2031	318.724	0,02				
GBP 478.579	Taurus 2021-4 UK 6,169% 17/8/2031	587.424	0,04				
GBP 285.648	Taurus 2021-4 UK 7,319% 17/8/2031	332.734	0,02				
EUR 1.476.664	Vita Scientia 2022-1 5,084% 27/2/2033	1.540.380	0,10				
		28.099.861	1,73				
	Italie						
EUR 340.000	ACEA 0% 28/9/2025	340.129	0,02				
EUR 420.480	AutoFlorence 2 4,387% 24/12/2044	448.701	0,03				
EUR 286.314	AutoFlorence 2 4,787% 24/12/2044	302.025	0,02				
EUR 153.531	AutoFlorence 2 5,987% 24/12/2044	163.283	0,01				
EUR 167.000	AutoFlorence 3 5,992% 25/12/2046	181.591	0,01				
EUR 143.000	Brignole 2021 4,437% 24/7/2036	154.138	0,01				
EUR 100.000	Brignole 2021 5,237% 24/7/2036	106.634	0,01				
EUR 270.000	CA Auto Bank 0% 16/4/2024	285.668	0,02				
EUR 180.000	CA Auto Bank 0,125% 16/11/2023	193.737	0,01				
EUR 620.000	CA Auto Bank 0,5% 18/9/2023	672.074	0,04				
EUR 979.765	Cassia 2022-1 5,883% 22/5/2034	1.018.239	0,06				
EUR 468.531	Cassia 2022-1 6,883% 22/5/2034	469.739	0,03				
EUR 1.040.000	Eni 3,625% 19/5/2027	1.118.921	0,07				
EUR 256.287	Progetto Quinto 4,23% 27/10/2036	277.732	0,02				
EUR 518.311	Red & Black Auto Italy 6,482% 28/12/2031	548.876	0,03				
EUR 320.000	Snam 0% 15/8/2025	321.797	0,02				
USD 310.000	Telecom Italia 5,303% 30/5/2024	306.313	0,02				
		6.909.597	0,43				
					Japon		
EUR 621.000	Asahi 0,01% 19/4/2024	656.782	0,04				
EUR 190.000	Asahi 0,155% 23/10/2024	197.278	0,01				
USD 310.000	Mitsubishi UFJ Financial 4,08% 19/4/2028	294.503	0,02				
USD 5.510.000	Mitsubishi UFJ Financial 4,788% 18/7/2025	5.447.904	0,34				
USD 1.525.000	Mitsubishi UFJ Financial 5,719% 20/2/2026	1.520.594	0,09				
EUR 847.000	Mizuho Financial 0,523% 10/6/2024	894.449	0,05				
USD 505.000	Mizuho Financial 1,234% 22/5/2027	446.931	0,03				
USD 200.000	Mizuho Financial 4,018% 5/3/2028	188.218	0,01				
EUR 185.000	Nissan Motor 2,652% 17/3/2026	190.618	0,01				
USD 2.671.000	Nissan Motor 3,043% 15/9/2023	2.669.472	0,17				
USD 1.400.000	Nissan Motor 4,345% 17/9/2027*	1.280.839	0,08				
USD 300.000	Nomura 1,851% 16/7/2025	277.412	0,02				
USD 200.000	Nomura 2,648% 16/1/2025	190.881	0,01				
USD 200.000	Nomura 5,709% 9/1/2026	198.762	0,01				
USD 2.409.000	Sumitomo Mitsui Financial 5,464% 13/1/2026	2.401.128	0,15				
		16.855.771	1,04				
					Jersey		
USD 1.342.000	Aptiv / Aptiv 2,396% 18/2/2025	1.277.485	0,08				
EUR 1.230.000	Heathrow Funding 1,5% 12/10/2025	1.264.509	0,08				
		2.541.994	0,16				
					Liberia		
USD 83.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 31/8/2026	79.825	0,01				
USD 5.000	Royal Caribbean Cruises 5,5% 1/4/2028	4.699	0,00				
USD 30.000	Royal Caribbean Cruises 7,25% 15/1/2030	30.478	0,00				
USD 30.000	Royal Caribbean Cruises 8,25% 15/1/2029	31.370	0,00				
USD 46.000	Royal Caribbean Cruises 9,25% 15/1/2029	49.028	0,00				
USD 10.000	Royal Caribbean Cruises 11,5% 1/6/2025	10.579	0,00				
USD 31.000	Royal Caribbean Cruises 11,625% 15/8/2027	33.812	0,00				
		239.791	0,01				
					Luxembourg		
USD 200.000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4,625% 1/6/2028	169.180	0,01				
USD 200.000	Altice Financing 5% 15/1/2028	162.957	0,01				
EUR 528.000	BL Consumer Credit 2021 4,742% 25/9/2038	569.344	0,03				
EUR 681.000	BL Consumer Credit 2021 5,292% 25/9/2038	731.610	0,05				
EUR 355.000	BL Consumer Credit 2021 6,492% 25/9/2038	379.041	0,02				
USD 68.000	Camelot Finance 4,5% 1/11/2026	63.723	0,00				
USD 242.000	Connect Finco / Connect US Finco 6,75% 1/10/2026	229.710	0,02				
EUR 700.000	FACT Master 4,582% 20/7/2028	753.264	0,05				
EUR 599.960	Germany Compartment Consumer 2020-1 4,771% 14/11/2034	650.630	0,04				
EUR 319.979	Germany Compartment Consumer 2020-1 5,371% 14/11/2034	346.945	0,02				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 239.984	Germany Compartment Consumer 2020-1 6,121% 14/11/2034	259.133	0,02	USD 94.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3,15% 1/10/2026	85.133	0,01
USD 200.000	Herens Holdco 4,75% 15/5/2028	153.835	0,01	EUR 310.000	Toyota Motor Finance Netherlands 0% 27/10/2025	310.689	0,02
EUR 220.000	Holcim Finance Luxembourg 0,125% 19/7/2027	209.799	0,01	USD 311.000	Trivium Packaging Finance 5,5% 15/8/2026	293.933	0,02
EUR 270.000	SIG Combibloc PurchaseCo 2,125% 18/6/2025	282.381	0,02	EUR 381.000	Viterra Finance 0,375% 24/9/2025*	380.204	0,02
USD 200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5,5% 1/3/2028	183.800	0,01	USD 194.000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	180.688	0,01
EUR 500.000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024	524.424	0,03			17.238.914	1,05
EUR 500.000	Traton Finance Luxembourg 0,125% 10/11/2024*	516.895	0,03		Panama		
EUR 200.000	Traton Finance Luxembourg 4,125% 22/11/2025	215.631	0,02	USD 30.000	Carnival 4% 1/8/2028	26.935	0,00
		6.402.302	0,40	USD 147.000	Carnival 5,75% 1/3/2027	138.075	0,01
				USD 37.000	Carnival 6% 1/5/2029	33.271	0,00
				USD 17.000	Carnival 7% 15/8/2029	17.279	0,00
				USD 13.000	Carnival 7,625% 1/3/2026	12.971	0,00
						228.531	0,01
	Malte				Portugal		
USD 14.000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6,375% 1/2/2030	11.487	0,00	EUR 164.670	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 5,887% 25/1/2035	176.041	0,01
				EUR 713.570	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 7,887% 25/1/2035	759.147	0,05
	Pays-Bas			EUR 611.147	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Ulisses Finance No. 2 6,462% 23/9/2038	622.349	0,04
EUR 600.000	Bayer Capital 1,5% 26/6/2026	611.486	0,04	EUR 1.076.682	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 4,332% 28/10/2040	1.163.807	0,07
EUR 490.000	Conti-Gummi Finance 1,125% 25/9/2024	514.903	0,03	EUR 143.558	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 4,582% 28/10/2040	152.446	0,01
EUR 1.115.000	Digital Dutch Finco 0,625% 15/7/2025	1.117.310	0,07	EUR 502.451	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/ Viriato Finance No 1 5,182% 28/10/2040	523.064	0,03
EUR 483.920	Domi 2021-1 4,156% 15/6/2053	522.228	0,03			3.396.854	0,21
EUR 1.603.159	Domi 2022-1 4,513% 15/4/2054	1.732.283	0,11		Arabie Saoudite		
EUR 608.859	Dutch Property Finance 2020-2 4,504% 28/1/2058	660.516	0,04	USD 865.000	Saudi Arabian Oil 2,875% 16/4/2024	849.075	0,05
EUR 290.000	Dutch Property Finance 2020-2 5,064% 28/1/2058	313.756	0,02		Singapour		
EUR 1.026.517	Dutch Property Finance 2021-1 4,364% 28/7/2058	1.113.463	0,07	USD 1.634.000	Pfizer Investment Enterprises 4,45% 19/5/2028	1.602.172	0,10
EUR 740.000	Dutch Property Finance 2021-1 4,814% 28/7/2058	797.178	0,05		Espagne		
EUR 887.136	Dutch Property Finance 2021-2 4,414% 28/4/2059	960.160	0,06	EUR 488.430	Autonomia Spain 2021 FT 4,442% 31/1/2039	523.450	0,03
EUR 820.000	Dutch Property Finance 2021-2 4,514% 28/4/2059	869.614	0,06	EUR 122.108	Autonomia Spain 2021 FT 5,192% 31/1/2039	129.223	0,01
EUR 504.000	Dutch Property Finance 2021-2 4,764% 28/4/2059	527.877	0,03	EUR 305.269	Autonomia Spain 2021 FT 6,292% 31/1/2039	319.931	0,02
EUR 230.000	Haleon Netherlands Capital 1,25% 29/3/2026	233.633	0,01	EUR 122.108	Autonomia Spain 2021 FT 7,542% 31/1/2039	126.973	0,01
EUR 500.000	ING Groep 0,1% 3/9/2025	520.683	0,03	EUR 400.000	Banco de Sabadell 0,625% 7/11/2025	414.442	0,03
EUR 800.000	ING Groep 1% 20/9/2023	866.841	0,05	USD 800.000	Banco Santander 2,746% 28/5/2025	756.915	0,05
USD 900.000	ING Groep 1,726% 1/4/2027	809.701	0,05	USD 200.000	Banco Santander 5,147% 18/8/2025	196.687	0,01
EUR 201.000	Jubilee Place 5,263% 17/1/2059	209.645	0,01	EUR 194.321	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3,5% 21/3/2033	199.038	0,01
EUR 350.000	Louis Dreyfus Finance 2,375% 27/11/2025	364.131	0,02	EUR 233.185	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 4,522% 21/3/2033	250.284	0,01
EUR 75.810	Magoi 2019 4,932% 27/7/2039	81.135	0,01				
EUR 450.000	Mercedes-Benz International Finance 0,25% 6/11/2023*	485.133	0,03				
USD 742.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2,7% 1/5/2025	706.021	0,04				
USD 675.000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4,3% 18/6/2029	632.161	0,04				
EUR 200.000	Redexis Gas Finance 1,875% 28/5/2025	208.308	0,01				
USD 80.000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	70.442	0,00				
USD 47.000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	45.859	0,00				
EUR 935.000	Siemens Financieringsmaatschappij 0,375% 6/9/2023	1.013.800	0,06				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
EUR 116.593	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5,522% 21/3/2033	124.540	0,01	GBP 424.000	Funding V 6,395% 15/10/2025	537.304	0,03
				GBP 115.000	Funding V 6,895% 15/10/2025	145.561	0,01
				GBP 210.000	Funding VI 8,295% 15/7/2026	267.857	0,02
		3.041.483	0,19	GBP 370.455	Gemgarto 2021-1 5,587% 16/12/2067	468.015	0,03
	Suisse			GBP 668.000	Gemgarto 2021-1 6,097% 16/12/2067	841.049	0,05
USD 2.000.000	Credit Suisse 0,495% 2/2/2024	1.951.597	0,12	GBP 218.000	Gemgarto 2021-1 6,297% 16/12/2067	271.313	0,02
USD 1.900.000	Credit Suisse 3,7% 21/2/2025	1.830.474	0,11	GBP 720.000	Harben Finance 5,992% 28/9/2055	890.620	0,05
USD 2.300.000	Credit Suisse 7,5% 15/2/2028	2.454.338	0,15	GBP 730.000	Harben Finance 6,242% 28/9/2055	883.048	0,05
EUR 715.000	UBS 0,25% 29/1/2026	730.743	0,05	GBP 441.000	Harben Finance 6,592% 28/9/2055	515.261	0,03
USD 3.220.000	UBS 1,494% 10/8/2027	2.831.821	0,17	GBP 542.843	Hops Hill No 1 6,145% 27/5/2054	688.175	0,04
USD 2.300.000	UBS 4,703% 5/8/2027	2.228.857	0,14	GBP 124.993	Hops Hill No 1 6,795% 27/5/2054	158.043	0,01
		12.027.830	0,74	GBP 199.992	Hops Hill No 1 7,045% 27/5/2054	252.899	0,02
	Royaume-Uni			GBP 99.998	Hops Hill No 1 7,545% 27/5/2054	124.930	0,01
GBP 100.000	Atlas Funding 2021-1 6,674% 25/7/2058	126.743	0,01	USD 788.000	HSBC 2,251% 22/11/2027	702.343	0,05
GBP 100.000	Atlas Funding 2021-1 6,874% 25/7/2058	126.459	0,01	USD 200.000	HSBC 2,999% 10/3/2026	190.864	0,01
GBP 100.000	Atlas Funding 2021-1 7,424% 25/7/2058	126.351	0,01	USD 1.091.000	HSBC 4,041% 13/3/2028	1.023.834	0,06
GBP 744.865	Azure Finance NO 2 8,195% 20/7/2030	946.221	0,06	USD 556.000	HSBC 4,583% 19/6/2029	523.933	0,03
USD 235.000	Barclays 3,932% 7/5/2025	231.582	0,01	USD 200.000	HSBC 4,755% 9/6/2028	191.747	0,01
USD 899.000	Barclays 4,375% 12/1/2026	866.527	0,05	USD 264.000	HSBC 5,21% 11/8/2028	257.489	0,02
USD 2.135.000	Barclays 5,501% 9/8/2028	2.080.687	0,13	USD 523.000	HSBC 7,39% 3/11/2028	549.187	0,03
USD 4.008.000	Barclays 5,829% 9/5/2027	3.970.986	0,25	EUR 239.000	Informa 2,125% 6/10/2025	248.506	0,02
USD 943.000	Barclays 7,385% 2/11/2028	981.654	0,06	GBP 150.750	Lanark Master Issuer 5,789% 22/12/2069	191.241	0,01
GBP 202.000	Barley Hill NO 2 6,595% 27/8/2058	250.063	0,02	GBP 657.035	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 6,058% 12/6/2057	834.147	0,05
GBP 115.000	Barley Hill NO 2 6,895% 27/8/2058	140.145	0,01	GBP 370.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7,208% 12/6/2057	465.855	0,03
EUR 545.000	BAT International Finance 0,875% 13/10/2023	589.149	0,04	GBP 159.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,409% 20/7/2058	193.655	0,01
USD 4.963.000	BAT International Finance 5,931% 2/2/2029	4.948.129	0,31	GBP 103.000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6,809% 20/7/2058	123.276	0,01
GBP 310.627	Brants Bridge 2022-1 6,208% 12/12/2064	394.900	0,02	GBP 361.562	London Wall Mortgage Capital 6,018% 15/5/2052	455.412	0,03
GBP 102.000	Canada Square Funding 2021-2 6,614% 17/6/2058	126.200	0,01	USD 12.000	Macquarie Airfinance 8,375% 1/5/2028	12.249	0,00
GBP 318.000	Canada Square Funding 6 6,601% 17/1/2059	385.622	0,02	GBP 305.000	Mortimer BTL 2021-1 6,133% 23/6/2053	379.702	0,02
GBP 178.000	Canada Square Funding 6 7,001% 17/1/2059	210.072	0,01	GBP 108.000	Mortimer BTL 2021-1 6,483% 23/6/2053	132.171	0,01
GBP 139.822	CMF 2020-1 5,796% 16/1/2057	177.188	0,01	EUR 600.000	National Grid Electricity Transmission 0,19% 20/1/2025	617.931	0,04
GBP 220.000	CMF 2020-1 6,196% 16/1/2057	278.500	0,02	USD 290.000	NatWest Markets 1,6% 29/9/2026	256.027	0,02
GBP 105.000	CMF 2020-1 6,446% 16/1/2057	132.706	0,01	GBP 775.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6,745% 15/3/2029	979.600	0,06
GBP 18.251	Dowson 2021-2 5,875% 20/10/2028	23.138	0,00	GBP 735.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6,095% 15/11/2029	926.924	0,06
GBP 700.000	Dowson 2021-2 6,395% 20/10/2028	887.555	0,05	GBP 404.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6,545% 15/11/2029	506.280	0,03
GBP 800.000	Dowson 2021-2 6,795% 20/10/2028	1.012.107	0,06	GBP 1.156.000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-1 6,495% 15/4/2030	1.463.645	0,09
GBP 331.000	Dowson 2022-1 6,945% 20/1/2029	420.410	0,03	USD 910.000	NTT Finance 4,372% 27/7/2027	886.692	0,06
GBP 172.000	Dowson 2022-1 7,445% 20/1/2029	216.782	0,01				
GBP 100.000	Dowson 2022-1 7,895% 20/1/2029	124.529	0,01				
USD 200.000	eG Global Finance 6,75% 7/2/2025	196.679	0,01				
GBP 1.045.000	Finsbury Square 6,247% 16/12/2067	1.281.852	0,08				
GBP 806.061	Finsbury Square 2021-2 5,797% 16/12/2071	1.017.322	0,06				
GBP 730.000	Finsbury Square 2021-2 6,247% 16/12/2071	914.711	0,06				
GBP 371.000	Finsbury Square 2021-2 6,397% 16/12/2071	454.684	0,03				
GBP 201.000	Finsbury Square 2021-2 6,697% 16/12/2071	240.013	0,01				

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 262.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4,25% 15/10/2027	238.627	0,02	EUR 1.770.000	AT&T 3,55% 18/11/2025	1.902.081	0,12
USD 62.000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6,75% 15/4/2028	61.163	0,00	USD 55.000	ATI 5,875% 1/12/2027	53.583	0,00
USD 204.000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6,625% 15/7/2026	194.430	0,01	USD 58.000	ATI 7,25% 15/8/2030	58.584	0,00
USD 25.000	Alteryx 8,75% 15/3/2028*	24.188	0,00	USD 2.000	Avantor Funding 3,875% 1/11/2029	1.754	0,00
USD 47.000	AMC Networks 4,75% 1/8/2025	44.046	0,00	USD 154.000	Avantor Funding 4,625% 15/7/2028	143.047	0,01
USD 42.494	American Airlines/AAAdvantage Loyalty IP 5,5% 20/4/2026	41.789	0,00	USD 9.000	Avient 7,125% 1/8/2030	9.020	0,00
USD 4.714.000	American Express 2,55% 4/3/2027	4.283.053	0,27	USD 299.000	Axalta Coating Systems 3,375% 15/2/2029	253.853	0,02
USD 2.404.000	American Express 3,625% 5/12/2024	2.340.314	0,15	USD 19.000	Ball 6% 15/6/2029	18.716	0,00
USD 1.600.000	American Honda Finance 5,25% 7/7/2026	1.601.750	0,10	USD 10.585	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 3,887% 25/11/2033	9.555	0,00
EUR 1.400.000	American Tower 0,4% 15/2/2027	1.329.962	0,08	USD 1.555.000	Bank of America 1,197% 24/10/2026	1.408.498	0,09
EUR 1.050.000	American Tower 0,45% 15/1/2027	1.001.270	0,06	USD 2.694.000	Bank of America 1,319% 19/6/2026	2.478.734	0,15
USD 304.000	American Tower 1,3% 15/9/2025	278.738	0,02	USD 3.067.000	Bank of America 1,53% 6/12/2025	2.900.270	0,18
USD 3.900.000	American Tower 1,45% 15/9/2026	3.454.081	0,21	USD 1.575.000	Bank of America 2,015% 13/2/2026	1.485.084	0,09
USD 1.053.000	American Tower 1,6% 15/4/2026	950.797	0,06	USD 365.000	Bank of America 2,456% 22/10/2025	350.852	0,02
USD 649.000	American Tower 4,4% 15/2/2026	631.565	0,04	USD 600.000	Bank of America 4,376% 27/4/2028	575.638	0,04
USD 3.590.000	American Tower 5,25% 15/7/2028	3.533.813	0,22	USD 2.800.000	Bank of America 5,08% 20/1/2027	2.761.337	0,17
USD 32.000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9,375% 1/6/2028	32.727	0,00	USD 155.000	Bank of America 5,202% 25/4/2029	152.662	0,01
USD 162.000	Amgen 2,2% 21/2/2027	147.107	0,01	USD 1.953.000	Bank of America 5,526% 18/8/2026	1.965.007	0,12
USD 5.414.000	Amgen 5,15% 2/3/2028	5.404.582	0,33	USD 2.588.000	Bank of America 6,204% 10/11/2028	2.645.208	0,16
USD 42.000	AmWINS 4,875% 30/6/2029	37.712	0,00	USD 4.784.000	BAT Capital 3,222% 15/8/2024	4.666.789	0,29
USD 17.000	ANGI 3,875% 15/8/2028	13.606	0,00	USD 9.000	Beacon Roofing Supply 4,125% 15/5/2029	7.759	0,00
USD 3.306.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4% 13/4/2028	3.180.180	0,20	USD 25.000	Beacon Roofing Supply 6,5% 1/8/2030	24.654	0,00
USD 173.000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 7,875% 15/5/2026	175.851	0,01	EUR 398.000	Becton Dickinson 0,034% 13/8/2025	400.839	0,03
USD 79.000	Antero Resources 7,625% 1/2/2029	80.611	0,01	USD 143.000	Big River Steel / BRS Finance 6,625% 31/1/2029	142.377	0,01
USD 2.041.000	Aon / Aon Global 2,85% 28/5/2027	1.878.693	0,12	USD 74.000	Black Knight InfoServ 3,625% 1/9/2028	68.635	0,00
USD 44.000	APX 6,75% 15/2/2027	42.623	0,00	USD 205.000	Block 2,75% 1/6/2026	186.268	0,01
USD 45.000	Aramark Services 5% 1/4/2025	44.485	0,00	USD 4.000	Blue Owl Credit Income 3,125% 23/9/2026	3.524	0,00
USD 63.000	Aramark Services 5% 1/2/2028	58.849	0,01	USD 45.000	Blue Owl Credit Income 7,75% 16/9/2027	44.720	0,00
USD 55.000	Aramark Services 6,375% 1/5/2025	55.202	0,00	USD 3.800.000	BMW US Capital 5,05% 11/8/2028	3.778.260	0,24
USD 123.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,25% 1/4/2028	117.729	0,01	USD 620.000	Boeing 2,196% 4/2/2026	572.131	0,04
USD 66.000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6,875% 1/4/2027	64.987	0,00	USD 990.000	Boeing 3,1% 1/5/2026	932.110	0,06
USD 58.000	Arcosa 4,375% 15/4/2029	51.930	0,00	EUR 840.000	Booking 0,1% 8/3/2025	860.956	0,05
USD 200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	196.077	0,01	USD 81.000	Booz Allen Hamilton 3,875% 1/9/2028	73.455	0,01
USD 21.000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	21.419	0,00	USD 101.000	Boston Properties 6,75% 1/12/2027	103.143	0,01
USD 3.000	Asbury Automotive 4,75% 1/3/2030	2.630	0,00	USD 212.000	Boxer Parent 7,125% 2/10/2025	212.456	0,01
USD 64.000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5,875% 30/6/2029	58.337	0,00	USD 45.000	Boyne USA 4,75% 15/5/2029	40.611	0,00
EUR 845.000	AT&T 1,05% 5/9/2023	916.678	0,06	USD 146.000	Brand Industrial Services 10,375% 1/8/2030	149.944	0,01
USD 1.099.000	AT&T 1,7% 25/3/2026	1.002.330	0,06	USD 187.000	Broadcom 1,95% 15/2/2028	162.152	0,01
				USD 103.000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3,5% 15/1/2028	94.919	0,01
				USD 696.000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3,875% 15/1/2027	660.823	0,04

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 42.000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGSJ Sellco LL 4,5% 1/4/2027	35.120	0,00	USD 3.180.000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 3,217% 10/11/2049	2.927.676	0,18
USD 15.000	Buckeye Partners 4,125% 1/3/2025	14.433	0,00	USD 33.000	Charles River Laboratories International 4,25% 1/5/2028	30.287	0,00
USD 70.000	Buckeye Partners 4,5% 1/3/2028	63.063	0,00	USD 628.000	Charles Schwab 3,2% 2/3/2027	580.872	0,04
USD 82.000	BWX Technologies 4,125% 30/6/2028	74.357	0,01	USD 5.805.000	Charles Schwab 5,875% 24/8/2026	5.838.250	0,36
USD 1.130.000	BX Trust 2018-BILT 7,378% 15/5/2030	1.111.421	0,07	USD 54.000	Chart Industries 7,5% 1/1/2030	55.479	0,00
USD 239.000	Caesars Entertainment 6,25% 1/7/2025	237.298	0,02	USD 358.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3,75% 15/2/2028	327.545	0,02
USD 165.000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	165.369	0,01	USD 2.766.000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4,2% 15/3/2028	2.574.803	0,16
USD 53.000	Caesars Resort Collection / CRC Finco 5,75% 1/7/2025	53.063	0,00	USD 15.000	Chemours 4,625% 15/11/2029	12.482	0,00
USD 32.000	Callon Petroleum 6,375% 1/7/2026	31.611	0,00	USD 4.000	Chemours 5,75% 15/11/2028	3.585	0,00
USD 69.000	Callon Petroleum 7,5% 15/6/2030	67.931	0,00	USD 146.000	Cheniere Energy Partners 4,5% 1/10/2029	134.772	0,01
USD 75.000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	76.079	0,01	USD 97.000	Chesapeake Energy 6,75% 15/4/2029	96.378	0,01
USD 85.000	Calpine 4,625% 1/2/2029	73.952	0,00	USD 115.378	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 4,004% 20/12/2035	103.833	0,01
USD 73.000	Calpine 5,25% 1/6/2026	71.774	0,00	USD 110.000	Chobani / Chobani Finance 4,625% 15/11/2028	98.803	0,01
USD 34.000	Camelot Return Merger Sub 8,75% 1/8/2028	33.708	0,00	USD 79.000	CHS/Community Health Systems 5,25% 15/5/2030	62.327	0,00
USD 7.100.000	Capital One Financial 1,343% 6/12/2024	6.997.338	0,43	USD 12.000	CHS/Community Health Systems 5,625% 15/3/2027	10.612	0,00
USD 3.100.000	Capital One Financial 4,166% 9/5/2025	3.041.784	0,19	USD 37.000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	31.029	0,00
USD 3.482.000	Capital One Financial 5,468% 1/2/2029	3.376.382	0,21	EUR 340.000	Chubb INA 0,3% 15/12/2024	351.391	0,02
USD 3.000.000	Capital One Financial 5,888% 6/12/2024	2.966.148	0,18	USD 60.000	Churchill Downs 4,75% 15/1/2028	55.457	0,00
USD 3.290.000	Capital One Financial 6,312% 8/6/2029	3.287.295	0,20	USD 158.000	Churchill Downs 5,5% 1/4/2027	152.350	0,01
USD 36.000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	35.488	0,00	USD 67.000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	66.407	0,00
USD 12.000	Carpenter Technology 6,375% 15/7/2028	11.740	0,00	USD 2.824.000	Citigroup 1,462% 9/6/2027	2.514.290	0,16
USD 69.000	Catalent Pharma Solutions 3,125% 15/2/2029	58.022	0,00	USD 566.000	Citigroup 2,014% 25/1/2026	535.423	0,03
USD 22.000	Catalent Pharma Solutions 3,5% 1/4/2030	18.517	0,00	USD 2.480.000	Citigroup 3,52% 27/10/2028	2.287.501	0,14
USD 2.000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	1.869	0,00	USD 1.792.000	Citigroup 4,14% 24/5/2025	1.768.196	0,11
USD 298.000	CCO / CCO Capital 5,125% 1/5/2027	281.122	0,02	USD 446.000	Citigroup 5,61% 29/9/2026	443.789	0,03
USD 150.000	CCO / CCO Capital 5,375% 1/6/2029	137.115	0,01	USD 2.620.496	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 3,251% 10/5/2035	2.446.841	0,15
USD 90.000	CCO / CCO Capital 6,375% 1/9/2029	85.406	0,01	USD 120.807	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 3,552% 11/3/2047	120.499	0,01
USD 1.853.742	CD 2016-CD1 Mortgage Trust 2,622% 10/8/2049	1.753.916	0,11	USD 3.380.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC21 3,855% 10/5/2047	3.332.396	0,21
USD 30.000	CD&R Smokey Buyer 6,75% 15/7/2025	29.238	0,00	USD 4.800.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 3,137% 10/2/2048	4.611.765	0,29
USD 8.000	CDI Escrow Issuer 5,75% 1/4/2030	7.475	0,00	USD 5.519.653	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29 2,935% 10/4/2048	5.352.171	0,33
USD 39.000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5,5% 1/5/2025	38.744	0,00	USD 2.054.249	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 2,779% 10/7/2049	1.965.057	0,12
USD 340.000	CenterPoint Energy Resources 5,25% 1/3/2028	339.268	0,02	USD 79.000	Civitas Resources 8,375% 1/7/2028	81.212	0,01
USD 60.000	Central Garden & Pet 5,125% 1/2/2028	56.477	0,00	USD 17.000	Clarios Global 6,75% 15/5/2025	17.031	0,00
USD 66.000	Central Parent / CDK Global 7,25% 15/6/2029	65.226	0,00	USD 88.000	Clarios Global / Clarios US Finance 6,75% 15/5/2028	87.863	0,01
USD 49.000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	49.662	0,00	USD 198.000	Clarivate Science 3,875% 1/7/2028	174.612	0,01

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 76.000	Clean Harbors 4,875% 15/7/2027	72.814	0,00	USD 12.000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	11.114	0,00
USD 215.000	Clear Channel Outdoor 5,125% 15/8/2027	193.030	0,01	USD 199.000	CrownRock / CrownRock Finance 5,625% 15/10/2025	195.697	0,01
USD 116.000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	116.568	0,01	USD 1.645.000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust 3,505% 15/4/2050	1.578.802	0,10
USD 62.000	Clearway Energy Operating 4,75% 15/3/2028	57.511	0,00	USD 200.000	CSC 5,375% 1/2/2028	163.890	0,01
USD 415.000	Cloud Software 6,5% 31/3/2029	371.202	0,02	USD 149.000	Cushman & Wakefield US Borrower 6,75% 15/5/2028	141.022	0,01
USD 91.000	Clydesdale Acquisition 6,625% 15/4/2029	86.719	0,01	USD 2.367.000	CVS Health 4,3% 25/3/2028	2.274.548	0,14
USD 118.000	Comcast 3,15% 15/2/2028	109.350	0,01	EUR 375.000	Danaher 1,7% 30/3/2024	401.344	0,03
USD 120.000	Comcast 3,3% 1/4/2027	113.253	0,01	USD 64.000	Darling Ingredients 5,25% 15/4/2027	62.317	0,00
USD 286.000	Comcast 3,55% 1/5/2028	269.885	0,02	USD 2.238.719	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6,409% 15/5/2035	2.231.443	0,14
USD 794.215	COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust 3,741% 10/6/2046	738.172	0,05	USD 1.115.931	DBJPM 2016-C3 Mortgage Trust 2,632% 10/8/2049	1.020.502	0,06
USD 3.000.000	COMM 2014-277P Mortgage Trust 3,732% 10/8/2049	2.836.297	0,18	USD 1.576.000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 6,491% 19/12/2030	1.566.425	0,10
USD 4.250.000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust 3,828% 15/7/2047	4.165.637	0,26	USD 1.810.000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	1.783.270	0,11
USD 4.744.426	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3,528% 10/12/2047	4.603.863	0,28	EUR 1.000.000	Digital Euro Finco 2,5% 16/1/2026	1.028.714	0,06
USD 5.000.000	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust 4,006% 10/4/2047	4.950.200	0,31	USD 67.000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5,875% 15/8/2027	59.521	0,00
USD 163.915	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust 3,367% 10/6/2047	163.347	0,01	USD 120.000	DISH DBS 5,25% 1/12/2026	101.628	0,01
USD 379.468	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 3,548% 10/9/2047	376.424	0,02	USD 105.000	DISH Network 11,75% 15/11/2027	106.740	0,01
USD 560.000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust 3,178% 10/2/2035	525.933	0,03	USD 694.000	DR Horton 1,3% 15/10/2026	611.691	0,04
USD 7.857.617	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 0,999% 10/5/2048	82.817	0,01	USD 126.000	DR Horton 1,4% 15/10/2027	108.199	0,01
USD 884.786	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 3,445% 10/8/2048	869.393	0,05	USD 12.000	Dream Finders Homes 8,25% 15/8/2028	12.178	0,00
USD 4.093.089	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 3,445% 10/7/2048	3.959.740	0,24	USD 94.000	DT Midstream 4,125% 15/6/2029	83.243	0,01
USD 75.000	CommScope 6% 1/3/2026	68.013	0,00	USD 61.000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029	54.521	0,00
USD 6.000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	5.490	0,00	USD 13.000	Dycom Industries 4,5% 15/4/2029	11.629	0,00
USD 109.000	Comstock Resources 6,75% 1/3/2029	102.027	0,01	USD 39.000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	39.815	0,00
USD 27.000	Consensus Cloud Solutions 6,5% 15/10/2028	24.302	0,00	USD 3.605.000	Edison International 4,7% 15/8/2025	3.525.138	0,22
USD 85.000	CoreLogic 4,5% 1/5/2028	69.564	0,01	USD 203.000	Element Solutions 3,875% 1/9/2028	178.521	0,01
USD 4.000	Coty/HFC Prestige Products/ HFC Prestige International US 4,75% 15/1/2029	3.669	0,00	USD 5.400.000	Elevance Health 3,65% 1/12/2027	5.090.629	0,31
USD 26.000	Coty/HFC Prestige Products/ HFC Prestige International US 6,625% 15/7/2030	25.927	0,00	USD 558.000	Elevance Health 5,35% 15/10/2025	557.083	0,04
USD 165.000	Crescent Energy Finance 7,25% 1/5/2026	162.367	0,01	USD 75.000	Enact 6,5% 15/8/2025	74.383	0,01
USD 41.000	Crescent Energy Finance 9,25% 15/2/2028	41.966	0,00	USD 29.000	Encompass Health 4,75% 1/2/2030	26.479	0,00
USD 23.000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	22.396	0,00	USD 850.000	Energy Transfer 2,9% 15/5/2025	807.622	0,05
USD 29.000	Crocs 4,25% 15/3/2029	24.479	0,00	USD 438.000	Energy Transfer 4,5% 15/4/2024	434.058	0,03
USD 89.000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	76.353	0,01	USD 4.400.000	Energy Transfer 5,875% 15/1/2024	4.397.049	0,27
USD 82.000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4,75% 1/2/2026	79.153	0,01	USD 62.000	EnLink Midstream 5,375% 1/6/2029	59.264	0,00
USD 1.420.000	Crown Castle 1,05% 15/7/2026	1.254.418	0,08	USD 35.000	EnLink Midstream 5,625% 15/1/2028	33.897	0,00
USD 887.000	Crown Castle 4,45% 15/2/2026	863.960	0,05	USD 118.000	EnLink Midstream Partners 4,85% 15/7/2026	113.390	0,01
USD 4.135.000	Crown Castle 4,8% 1/9/2028	4.011.354	0,25	USD 75.000	EnPro Industries 5,75% 15/10/2026	73.203	0,00
				USD 167.000	Entegris Escrow 4,75% 15/4/2029	155.209	0,01
				USD 2.700.000	Enterprise Products Operating 4,15% 16/10/2028	2.576.348	0,16
				USD 136.000	Enterprise Products Operating 5,05% 10/1/2026	135.296	0,01

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 47.000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	46.594	0,00	USD 183.963	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	173.615	0,01
USD 116.000	EQM Midstream Partners 6,5% 1/7/2027	115.223	0,01	USD 19.126	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2033	17.869	0,00
USD 543.000	Equinix 1,25% 15/7/2025	500.425	0,03	USD 7.410.627	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2033	7.007.604	0,43
USD 533.000	Equinix 1,45% 15/5/2026	478.550	0,03	USD 3.465.034	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2034	3.270.749	0,20
USD 1.063.000	Equinix 1,55% 15/3/2028	897.288	0,06	USD 760.813	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2035	702.291	0,04
USD 800.000	Equinix 1,8% 15/7/2027	698.704	0,04	USD 328.600	Fannie Mae Pool 3,126% 1/9/2044	320.113	0,02
USD 2.340.000	Eversource Energy 2,9% 1/3/2027	2.152.738	0,13	USD 82.978	Fannie Mae Pool 3,5% 1/4/2034	79.356	0,01
USD 276.000	Eversource Energy 4,6% 1/7/2027	268.467	0,02	USD 495.520	Fannie Mae Pool 3,5% 1/4/2034	473.895	0,03
USD 1.520.000	Eversource Energy 4,75% 15/5/2026	1.494.958	0,09	USD 732.294	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2033	708.056	0,04
USD 1.165.000	Eversource Energy 5,45% 1/3/2028	1.167.995	0,07	USD 577.780	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2033	560.119	0,03
USD 740.000	Exelon 2,75% 15/3/2027	678.937	0,04	USD 243.286	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	237.084	0,01
USD 1.710.000	Exelon 5,15% 15/3/2028	1.696.608	0,11	USD 310.530	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2034	301.429	0,02
USD 31.000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	28.369	0,00	USD 21.462	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	20.735	0,00
USD 6.336.198	Fannie Mae Pool 1,5% 1/6/2031	5.667.874	0,35	USD 164.477	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	158.929	0,01
USD 3.911.060	Fannie Mae Pool 2,5% 1/6/2035	3.531.215	0,22	USD 152.116	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	146.692	0,01
USD 14.850	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2027	14.321	0,00	USD 220.246	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2037	208.800	0,01
USD 23.351	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2028	22.345	0,00	USD 273.357	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2037	259.175	0,02
USD 286.475	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2030	270.359	0,02	USD 187.826	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2038	178.084	0,01
USD 113.075	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2030	106.493	0,01	USD 2.758.693	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2043	2.621.120	0,16
USD 29.301	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	27.653	0,00	USD 9.006.620	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2048	8.557.456	0,53
USD 17.385	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	16.411	0,00	USD 572.062	Fannie Mae Pool 4,5% 1/8/2037	557.345	0,03
USD 9.645	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	9.105	0,00	USD 2.432.218	Fannie Mae Pool 4,5% 1/10/2037	2.377.872	0,15
USD 36.456	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	34.413	0,00	USD 909.953	Fannie Mae Pool 4,5% 1/10/2037	889.575	0,06
USD 296.547	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	279.843	0,02	USD 2.197.320	Fannie Mae Pool 4,5% 1/10/2037	2.141.647	0,13
USD 43.171	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	40.746	0,00	USD 453.459	Fannie Mae Pool 4,5% 1/10/2037	444.916	0,03
USD 10.850	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	10.240	0,00	USD 576.419	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2037	565.325	0,04
USD 7.829	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2030	7.370	0,00	USD 592.957	Fannie Mae Pool 4,5% 1/3/2047	574.129	0,04
USD 211.743	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	199.392	0,01	USD 1.820.514	Fannie Mae Pool 4,5% 1/5/2047	1.762.653	0,11
USD 262.878	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	248.149	0,02	USD 244.810	Fannie Mae Pool 4,5% 1/7/2047	237.082	0,01
USD 35.057	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	33.019	0,00	USD 2.024.478	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2047	1.967.502	0,12
USD 12.978	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	12.222	0,00	USD 327.043	Fannie Mae Pool 4,5% 1/6/2048	316.670	0,02
USD 22.527	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	21.257	0,00	USD 1.004.213	Fannie Mae Pool 4,5% 1/11/2048	972.188	0,06
USD 219.082	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	206.760	0,01	USD 3.071.813	Fannie Mae Pool 4,5% 1/2/2049	2.981.148	0,18
USD 247.018	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	232.804	0,01	USD 857.528	Fannie Mae Pool 4,5% 1/4/2049	831.809	0,05
USD 19.433	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	18.337	0,00	USD 285.678	Fannie Mae Pool 4,704% 1/9/2042	289.701	0,02
USD 33.673	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2031	31.773	0,00	USD 258	Fannie Mae Pool 5% 1/7/2025	254	0,00
USD 31.898	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	30.040	0,00	USD 455.124	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2037	452.739	0,03
USD 46.729	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	44.092	0,00	USD 2.274.545	Fannie Mae Pool 5% 1/6/2039	2.273.497	0,14
USD 218.471	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	205.578	0,01	USD 1.889.075	Fannie Mae REMICS 1,5% 25/11/2050	1.597.474	0,10
USD 11.463	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	10.820	0,00	USD 7.292.534	Fannie Mae REMICS 6% 25/9/2052	7.076.619	0,44
USD 25.847	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2031	24.399	0,00	USD 14.000.000	Federal Farm Credit Banks Funding 0,71% 1/4/2025	13.014.653	0,80
USD 402.609	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2031	379.872	0,02	USD 2.000.000	Federal Farm Credit Banks Funding 1,3% 3/2/2031	1.559.254	0,10
USD 272.076	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2031	255.692	0,02	USD 8.500.000	Federal Farm Credit Banks Funding 1,68% 17/9/2035	5.914.600	0,37
USD 73.751	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2031	69.605	0,00	USD 2.000.000	Federal Farm Credit Banks Funding 2,17% 29/10/2029	1.716.608	0,11
USD 32.251	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	30.437	0,00	USD 5.500.000	Federal Farm Credit Banks Funding 2,25% 15/8/2029	4.787.500	0,30
USD 229.549	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	216.623	0,01	USD 1.150.000	Federal Farm Credit Banks Funding 2,78% 1/12/2036	892.682	0,05
USD 95.850	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2032	90.049	0,01	USD 4.000.000	Federal Home Loan Banks 0,6% 30/12/2026	3.507.175	0,22
USD 141.534	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2032	133.553	0,01	USD 2.560.000	Federal Home Loan Banks 1,4% 9/1/2031	2.009.724	0,12
USD 306.951	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	289.691	0,02	USD 3.000.000	Federal Home Loan Banks 1,61% 27/1/2033	2.258.564	0,14
USD 430.120	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	404.980	0,03	USD 4.000.000	Federal Home Loan Banks 2,06% 27/9/2029	3.451.055	0,21
USD 17.587	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	16.594	0,00	USD 3.500.000	Federal Home Loan Banks 2,18% 6/11/2029	3.018.543	0,19
USD 7.384	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	6.967	0,00	USD 1.150.000	Federal Home Loan Banks 2,5% 5/11/2036	864.736	0,05
USD 1.770.588	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	1.670.886	0,10	USD 4.000.000	Federal Home Loan Mortgage 0,65% 28/5/2026	3.575.905	0,22
USD 10.153	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2032	9.582	0,00				
USD 191.404	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2032	180.588	0,01				
USD 212.058	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	199.658	0,01				
USD 304.555	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	287.382	0,02				
USD 35.045	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	33.069	0,00				
USD 16.570	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	15.633	0,00				
USD 9.929	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	9.368	0,00				
USD 54.893	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	51.317	0,00				
USD 117.419	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	110.826	0,01				
USD 31.293	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	29.529	0,00				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 189.000	Federal Home Loan Mortgage 1,55% 20/11/2031	147.196	0,01	USD 1.461.020	Freddie Mac Non Gold Pool 3,219% 1/5/2045	1.416.416	0,09
USD 4.500.000	Federal Home Loan Mortgage 4,2% 28/8/2025	4.416.359	0,27	USD 484.434	Freddie Mac Pool 4,5% 1/10/2037	475.302	0,03
USD 4.500.000	Federal Home Loan Mortgage 5,68% 3/4/2025	4.477.558	0,28	USD 492.333	Freddie Mac Pool 4,5% 1/1/2050	479.925	0,03
USD 16.000.000	Federal National Mortgage Association 0,55% 19/8/2025	14.675.879	0,91	USD 3.881.878	Freddie Mac REMICS 1,5% 15/4/2044	3.672.894	0,23
USD 4.000.000	Federal National Mortgage Association 0,74% 25/8/2027	3.421.013	0,21	USD 727.200	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2044	646.561	0,04
USD 4.000.000	Federal National Mortgage Association 0,81% 25/9/2028	3.296.889	0,20	USD 2.067.133	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2045	1.814.122	0,11
USD 61.000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4,625% 15/1/2029	52.670	0,00	USD 1.308.411	Freddie Mac REMICS 3% 15/8/2043	1.175.814	0,07
USD 2.158.000	Fidelity National Information Services 1,15% 1/3/2026	1.941.825	0,12	USD 507.327	Freddie Mac REMICS 3% 15/1/2044	487.611	0,03
USD 2.700.000	Fidelity National Information Services 4,5% 15/7/2025	2.645.334	0,16	USD 1.398.140	Freddie Mac REMICS 3% 15/9/2046	1.291.566	0,08
USD 894.000	Fidelity National Information Services 4,7% 15/7/2027	875.519	0,05	USD 932.388	Freddie Mac REMICS 3% 25/7/2049	812.646	0,05
USD 535.000	Fifth Third Bancorp 6,339% 27/7/2029	541.134	0,03	USD 1.139.455	Freddie Mac REMICS 4% 15/12/2043	1.074.860	0,07
USD 1.235.000	Fifth Third Bank 5,852% 27/10/2025	1.217.096	0,08	USD 17.563	Freddie Mac REMICS 4,5% 15/9/2041	17.332	0,00
USD 250.000	Fiserv 3,2% 1/7/2026	235.594	0,02	USD 59.468	Freddie Mac REMICS 4,5% 15/11/2041	57.997	0,00
USD 2.200.000	Fiserv 5,45% 2/3/2028	2.212.157	0,14	USD 69.000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	59.146	0,00
USD 783.000	Florida Power & Light 4,4% 15/5/2028	765.287	0,05	USD 102.000	Frontier Communications 5,875% 15/10/2027	92.949	0,01
USD 2.180.000	Florida Power & Light 5,05% 1/4/2028	2.188.410	0,14	USD 16.000	Frontier Communications 8,75% 15/5/2030	15.533	0,00
USD 615.000	Ford Motor Credit 2,7% 10/8/2026	551.467	0,04	USD 12.000	FTAI Infra Escrow 10,5% 1/6/2027	12.017	0,00
USD 1.826.000	Ford Motor Credit 3,37% 17/11/2023	1.812.748	0,11	USD 46.000	Gartner 4,5% 1/7/2028	42.959	0,00
USD 200.000	Ford Motor Credit 7,2% 10/6/2030	202.501	0,01	USD 25.000	Gates Global / Gates 6,25% 15/1/2026	24.835	0,00
USD 261.000	Ford Motor Credit 7,35% 6/3/2030	265.955	0,02	USD 22.000	GCI 4,75% 15/10/2028	19.110	0,00
USD 19.000	Fortrea 7,5% 1/7/2030	18.772	0,00	USD 51.000	Gen Digital 6,75% 30/9/2027	51.027	0,00
USD 30.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 5,5% 1/5/2028	27.934	0,00	EUR 360.000	General Mills 0,45% 15/1/2026	360.472	0,02
USD 102.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 6,5% 1/10/2025	100.919	0,01	USD 297.000	General Mills 5,241% 18/11/2025	295.564	0,02
USD 16.000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 9,75% 1/8/2027	16.649	0,00	USD 266.000	General Motors 6,125% 1/10/2025	267.096	0,02
USD 661.209	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/9/2032	624.789	0,04	USD 176.000	General Motors Financial 1,25% 8/1/2026	158.305	0,01
USD 423.748	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/2/2036	391.262	0,02	USD 434.000	General Motors Financial 2,35% 26/2/2027	385.945	0,03
USD 816.797	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	790.724	0,05	USD 772.000	General Motors Financial 4% 15/1/2025	750.596	0,05
USD 968.544	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	942.503	0,06	USD 1.993.000	General Motors Financial 6% 9/1/2028	1.997.573	0,13
USD 855.793	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/3/2034	835.026	0,05	USD 6.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7,75% 1/2/2028	5.855	0,00
USD 46.344	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/11/2036	44.000	0,00	USD 11.000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8,875% 15/4/2030	10.953	0,00
USD 616.360	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2037	585.125	0,04	USD 36.000	Global Net Lease / Global Net Lease Operating Partnership 3,75% 15/12/2027	28.139	0,00
USD 198.165	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/7/2047	192.175	0,01	USD 2.764.000	Global Payments 1,2% 1/3/2026	2.472.798	0,16
USD 5.995.604	Freddie Mac Gold Pool 4,5% 1/3/2049	5.814.291	0,36	USD 1.058.000	Global Payments 2,15% 15/1/2027	942.794	0,06
USD 95.101.691	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0,788% 25/9/2024	493.416	0,03	USD 281.000	Global Payments 4,95% 15/8/2027	273.467	0,02
				USD 15.000	Go Daddy Operating / GD Finance 3,5% 1/3/2029	12.922	0,00
				USD 96.000	Go Daddy Operating / GD Finance 5,25% 1/12/2027	91.769	0,01

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
USD 1.030.000	Goldman Sachs 0,657% 10/9/2024	1.029.033	0,06	USD 82.000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4,875% 1/4/2027	79.195	0,01
USD 1.621.000	Goldman Sachs 1,431% 9/3/2027	1.453.217	0,09	EUR 710.000	Honeywell International 3,5% 17/5/2027*	762.053	0,05
USD 826.000	Goldman Sachs 1,948% 21/10/2027	734.602	0,05	USD 43.000	Howard Hughes 5,375% 1/8/2028	38.832	0,00
USD 2.787.000	Goldman Sachs 2,64% 24/2/2028	2.520.981	0,16	USD 30.000	Howard Midstream Energy Partners 8,875% 15/7/2028	30.862	0,00
USD 1.077.000	Goldman Sachs 4,482% 23/8/2028	1.036.229	0,07	USD 121.000	HP 4,75% 15/1/2028	117.874	0,01
USD 1.501.000	Goldman Sachs 5,798% 10/8/2026	1.495.756	0,09	USD 6.200.000	HSBC USA 5,625% 17/3/2025	6.185.112	0,38
USD 649.381	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4 1,93% 20/7/2048	488.597	0,03	USD 158.000	HUB International 7,25% 15/6/2030	160.141	0,01
USD 552.572	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2,31%20/10/2048	426.742	0,03	USD 8.000	Hughes Satellite Systems 5,25% 1/8/2026	7.304	0,00
USD 30.000	Goodyear Tire & Rubber 9,5% 31/5/2025	30.673	0,00	USD 2.471.000	Hyundai Capital America 1,65% 17/9/2026	2.194.271	0,14
USD 3.313.784	Government National Mortgage Association 0,641% 16/2/2053	52.267	0,00	USD 15.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4,375% 1/2/2029	11.872	0,00
USD 1.168.246	Government National Mortgage Association 1,5% 20/6/2050	912.126	0,06	USD 21.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4,75% 15/9/2024	20.320	0,00
USD 1.490.481	Government National Mortgage Association 3% 20/7/2045	1.403.399	0,09	USD 66.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5,25% 15/5/2027	57.854	0,00
USD 701.677	Government National Mortgage Association 3% 20/3/2047	635.568	0,04	USD 39.000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6,25% 15/5/2026	36.216	0,00
USD 28.000	GrafTech Global Enterprises 9,875% 15/12/2028	27.171	0,00	EUR 1.045.000	Illinois Tool Works 0,25% 5/12/2024	1.082.505	0,07
USD 33.000	Graham 5,75% 1/6/2026	32.287	0,00	USD 82.000	Imola Merger 4,75% 15/5/2029	73.037	0,00
USD 56.000	Graphic Packaging International 3,5% 15/3/2028	49.969	0,00	USD 2.079.000	Intercontinental Exchange 3,75% 21/9/2028*	1.960.838	0,12
USD 16.000	Greystar Real Estate Partners 7,75% 1/9/2030	16.150	0,00	USD 493.000	International Business Machines 3,45% 19/2/2026	472.677	0,03
USD 1.302.650	GS Mortgage Trust 2011-GC5 5,209% 10/8/2044	1.225.625	0,08	USD 497.000	International Business Machines 4,5% 6/2/2026	488.905	0,03
USD 3.495.242	GS Mortgage Trust 2014-GC18 4,074% 10/1/2047	3.465.527	0,21	USD 1.715.000	Invitation Homes Operating Partnership 5,45% 15/8/2030	1.678.124	0,10
USD 2.960.000	GS Mortgage Trust 2014-GC24 3,931% 10/9/2047	2.864.076	0,18	USD 308.000	IQVIA 5% 15/5/2027	296.140	0,02
USD 2.330.000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 3,764% 10/7/2048	2.223.300	0,14	USD 130.000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	129.916	0,01
USD 1.641.984	GS Mortgage Trust 2016-GS3 2,777% 10/10/2049	1.567.382	0,10	USD 18.000	JELD-WEN 4,625% 15/12/2025	17.435	0,00
USD 8.000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	8.132	0,00	USD 1.085.000	John Deere Capital 4,95% 14/7/2028	1.086.798	0,07
USD 20.000	GYP III 4,625% 1/5/2029	17.612	0,00	USD 1.015.678	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2013-C16 4,166% 15/12/2046	1.013.384	0,06
USD 14.000	Hanesbrands 4,875% 15/5/2026	13.112	0,00	USD 1.008.740	JP Morgan Mortgage Trust 2014-2 3% 25/6/2029	962.444	0,06
USD 35.000	HAT I / HAT II 3,375% 15/6/2026	31.436	0,00	USD 496.518	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 6,808% 25/6/2046	456.891	0,03
USD 1.324.000	HCA 5,25% 15/4/2025	1.311.671	0,08	USD 80.021	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2013-C17 3,705% 15/1/2047	79.809	0,01
USD 3.128.000	HCA 5,375% 1/2/2025	3.107.475	0,19	USD 919.932	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 3,657% 15/9/2047	904.886	0,06
USD 593.000	HCA 5,375% 1/9/2026	588.228	0,04	USD 232.923	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C26 3,288% 15/1/2048	228.907	0,01
USD 2.467.000	HCA 5,875% 15/2/2026	2.470.706	0,15	USD 879.964	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 3,504% 15/12/2048	833.892	0,05
USD 70.000	HealthEquity 4,5% 1/10/2029	62.126	0,00	USD 606.000	JPMorgan Chase 1,045% 19/11/2026	546.576	0,03
USD 820.000	Healthpeak 1,35% 1/2/2027	718.771	0,05	EUR 420.000	JPMorgan Chase 1,5% 27/1/2025	440.657	0,03
USD 61.000	Herc 5,5% 15/7/2027	58.754	0,00				
USD 31.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5,75% 1/2/2029	28.787	0,00				
USD 15.000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6,25% 1/11/2028	14.454	0,00				
USD 20.000	Hilton Domestic Operating 3,75% 1/5/2029	17.653	0,00				
USD 25.000	Hilton Domestic Operating 5,375% 1/5/2025	24.847	0,00				
USD 10.000	Hilton Domestic Operating 5,75% 1/5/2028	9.820	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 328.000	JPMorgan Chase 1,561% 10/12/2025	309.894	0,02	USD 56.000	Matador Resources 5,875% 15/9/2026	54.652	0,00
USD 1.850.000	JPMorgan Chase 1,578% 22/4/2027	1.661.977	0,10	USD 22.000	Matador Resources 6,875% 15/4/2028	22.027	0,00
USD 1.200.000	JPMorgan Chase 2,069% 1/6/2029	1.029.082	0,06	USD 103.000	Match II 4,625% 1/6/2028	94.991	0,01
USD 1.234.000	JPMorgan Chase 2,083% 22/4/2026	1.160.273	0,07	USD 301.000	Mauser Packaging Solutions 7,875% 15/8/2026	296.073	0,02
USD 1.581.000	JPMorgan Chase 3,782% 1/2/2028	1.491.899	0,09	USD 123.000	Medline Borrower 3,875% 1/4/2029	107.191	0,01
USD 1.100.000	JPMorgan Chase 3,96% 29/1/2027	1.057.880	0,07	USD 3.785.000	Mercedes-Benz Finance North America 5,2% 3/8/2026	3.776.165	0,23
USD 2.430.000	JPMorgan Chase 4,851% 25/7/2028	2.382.134	0,15	USD 92.000	Meritage Homes 5,125% 6/6/2027	88.478	0,01
USD 4.190.000	JPMorgan Chase 5,299% 24/7/2029	4.165.365	0,26	USD 48.000	MicroStrategy 6,125% 15/6/2028	43.002	0,00
USD 109.000	Kaiser Aluminum 4,625% 1/3/2028	96.148	0,01	USD 74.760	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6,5% 20/6/2027	74.556	0,01
USD 2.000	KBR 4,75% 30/9/2028	1.804	0,00	EUR 400.000	MMS USA 0,625% 13/6/2025	409.319	0,03
USD 46.000	Korn Ferry 4,625% 15/12/2027	42.828	0,00	USD 42.000	ModivCare 5,875% 15/11/2025	39.894	0,00
USD 162.000	Kraft Heinz Foods 3% 1/6/2026	152.598	0,01	USD 87.000	Molina Healthcare 4,375% 15/6/2028	80.111	0,01
USD 28.000	LABL 5,875% 1/11/2028	25.372	0,00	EUR 100.000	Morgan Stanley 0,406% 29/10/2027	96.295	0,01
USD 4.000	LABL 6,75% 15/7/2026	3.913	0,00	USD 2.755.000	Morgan Stanley 2,475% 21/1/2028	2.484.938	0,15
USD 49.000	LABL 9,5% 1/11/2028	50.501	0,00	USD 1.650.000	Morgan Stanley 5,164% 20/4/2029	1.617.444	0,10
USD 48.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4,25% 1/2/2027	43.461	0,00	USD 3.220.000	Morgan Stanley 5,449% 20/7/2029	3.197.605	0,20
USD 4.000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5,25% 1/10/2025	3.854	0,00	USD 5.100.000	Morgan Stanley 6,296% 18/10/2028	5.228.217	0,32
USD 363.000	Lam Research 3,8% 15/3/2025	354.315	0,02	USD 1.495.000	Morgan Stanley Bank 4,754% 21/4/2026	1.473.902	0,09
USD 81.000	Lamb Weston 4,875% 15/5/2028	76.617	0,01	USD 1.480.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 4,039% 15/11/2046	1.471.291	0,09
USD 21.000	Legacy LifePoint Health 4,375% 15/2/2027	18.165	0,00	USD 1.324.038	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C15 4,051% 15/4/2047	1.312.758	0,08
USD 20.000	Legends Hospitality Co / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	18.618	0,00	USD 456.325	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 3,621% 15/10/2047	451.867	0,03
USD 98.000	Level 3 Financing 3,4% 1/3/2027	89.725	0,01	USD 6.616.709	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C20 3,249% 15/2/2048	6.344.139	0,39
USD 76.000	Level 3 Financing 4,625% 15/9/2027	57.250	0,00	USD 2.625.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3,372% 15/10/2048	2.498.419	0,15
USD 70.000	Level 3 Financing 10,5% 15/5/2030	71.145	0,00	USD 4.189.500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3,635% 15/10/2048	3.974.557	0,25
USD 57.000	Life Time 5,75% 15/1/2026	55.641	0,00	USD 7.000.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 3,252% 15/10/2048	6.728.254	0,42
USD 33.000	LifePoint Health 9,875% 15/8/2030	32.574	0,00	USD 1.834.904	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30 2,729% 15/9/2049	1.755.334	0,11
USD 31.000	Lindblad Expeditions 6,75% 15/2/2027	30.058	0,00	USD 3.000.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 3,102% 15/11/2049	2.733.798	0,17
USD 28.000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	28.797	0,00	USD 193.000	MPLX 1,75% 1/3/2026	175.657	0,02
USD 21.000	Lions Gate Capital 5,5% 15/4/2029	12.710	0,00	USD 1.700.000	MPLX 4,25% 1/12/2027	1.616.616	0,10
USD 21.000	Live Nation Entertainment 3,75% 15/1/2028	18.750	0,00	USD 296.000	MPLX 4,875% 1/6/2025	291.194	0,02
USD 43.000	Live Nation Entertainment 4,75% 15/10/2027	39.940	0,00	USD 21.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4,625% 1/8/2029	15.214	0,00
USD 4.000	Live Nation Entertainment 5,625% 15/3/2026	3.883	0,00	USD 29.000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5,25% 1/8/2026	24.681	0,00
USD 134.000	Live Nation Entertainment 6,5% 15/5/2027	134.187	0,01				
USD 169.000	Lowe's 3,35% 1/4/2027	159.009	0,01				
USD 288.000	Lowe's 4,4% 8/9/2025	282.768	0,02				
USD 34.000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	21.282	0,00				
USD 980.000	LYB International Finance III 1,25% 1/10/2025	893.620	0,06				
USD 7.000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	6.791	0,00				

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 21.000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	18.551	0,00	USD 83.000	OneMain Finance 6,625% 15/1/2028	77.783	0,01
USD 65.000	Nabors Industries 7,375% 15/5/2027	63.619	0,00	USD 6.000	OneMain Finance 6,875% 15/3/2025	5.976	0,00
USD 2.900.000	Nasdaq 5,35% 28/6/2028	2.896.918	0,18	USD 29.000	OneMain Finance 7,125% 15/3/2026	28.585	0,00
USD 46.000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	43.857	0,00	USD 987.000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3,14% 14/10/2036	905.863	0,06
USD 45.000	Navient 6,75% 15/6/2026	44.157	0,00	USD 9.856.000	Oracle 1,65% 25/3/2026	8.976.657	0,56
USD 28.000	Navient 9,375% 25/7/2030	28.081	0,00	USD 1.320.000	Oracle 2,65% 15/7/2026	1.225.021	0,08
USD 2.000.000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3,16% 15/11/2068	1.678.891	0,10	USD 285.000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4,125% 30/4/2028	257.987	0,02
USD 396.880	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 6,325% 15/11/2068	392.217	0,03	USD 1.365.000	Otis Worldwide 5,25% 16/8/2028	1.373.471	0,09
USD 279.782	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D 3,01% 15/12/2059	258.946	0,02	USD 19.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4,25% 15/1/2029	15.604	0,00
USD 191.502	Navient Student Loan Trust 2018-EA 4% 15/12/2059	186.274	0,01	USD 108.000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	97.853	0,01
USD 76.000	NCR 5% 1/10/2028	69.797	0,01	USD 953.000	Pacific Gas and Electric 3,45% 1/7/2025	904.776	0,06
USD 32.000	Neptune Bidco US 9,29% 15/4/2029	29.837	0,00	USD 3.180.000	Pacific Gas and Electric 6,1% 15/1/2029	3.141.620	0,19
USD 72.000	New Fortress Energy 6,5% 30/9/2026	66.962	0,00	USD 575.000	Parker-Hannifin 2,7% 14/6/2024	561.460	0,04
USD 59.000	New Fortress Energy 6,75% 15/9/2025	57.091	0,00	USD 61.000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4,5% 15/8/2028	55.701	0,00
USD 306.639	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 3,25% 25/9/2056	277.940	0,02	USD 13.000	PBF / PBF Finance 7,875% 15/9/2030	12.980	0,00
USD 1.519.390	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 4% 25/12/2057	1.431.144	0,09	USD 29.000	PDC Energy 5,75% 15/5/2026	28.982	0,00
USD 2.000.000	Newell Brands 4,7% 1/4/2026*	1.908.452	0,12	USD 535.000	PeaceHealth Obligated 1,375% 15/11/2025	487.321	0,03
USD 175.000	NextEra Energy Capital 1,875% 15/1/2027	156.385	0,01	USD 34.000	Penske Automotive 3,5% 1/9/2025	32.474	0,00
USD 274.000	NextEra Energy Capital 1,9% 15/6/2028	235.255	0,01	USD 606.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1,2% 15/11/2025	545.447	0,04
USD 229.000	NextEra Energy Capital 3,55% 1/5/2027	215.729	0,01	USD 1.285.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1,7% 15/6/2026	1.144.747	0,07
USD 125.000	NextEra Energy Capital 4,625% 15/7/2027	121.856	0,01	USD 359.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	345.824	0,02
USD 27.000	NextEra Energy Operating Partners 4,25% 15/7/2024	26.518	0,00	USD 166.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4,4% 1/7/2027	156.905	0,01
USD 181.000	NFP 4,875% 15/8/2028	161.762	0,01	USD 200.000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4,45% 29/1/2026	192.687	0,01
USD 54.000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7,5% 1/2/2026	53.657	0,00	USD 43.000	Performance Food 5,5% 15/10/2027	41.304	0,00
USD 1.515.000	NiSource 5,25% 30/3/2028	1.508.153	0,09	USD 2.000	Permian Resources Operating 5,875% 1/7/2029	1.936	0,00
USD 1.727.000	Nissan Motor Acceptance 1,85% 16/9/2026	1.495.036	0,09	USD 84.000	Permian Resources Operating 6,875% 1/4/2027	83.533	0,01
USD 380.000	Nissan Motor Acceptance 2,75% 9/3/2028	320.450	0,02	USD 170.000	Permian Resources Operating 7,75% 15/2/2026	171.918	0,01
USD 1.584.000	Norfolk Southern 3,8% 1/8/2028	1.492.748	0,09	USD 520.000	Piedmont Natural Gas 3,5% 1/6/2029	471.954	0,03
USD 116.000	Northern Oil and Gas 8,125% 1/3/2028	116.384	0,01	USD 1.676.000	Pioneer Natural Resources 1,125% 15/1/2026	1.518.408	0,09
USD 71.000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4,75% 30/4/2027	61.971	0,00	USD 1.025.000	Pioneer Natural Resources 5,1% 29/3/2026	1.016.453	0,06
USD 251.000	Novelis 3,25% 15/11/2026	227.806	0,01	USD 6.000	Playtika 4,25% 15/3/2029	5.188	0,00
USD 418.000	NRG Energy 3,75% 15/6/2024	406.784	0,03	USD 3.100.000	PNC Financial Services 5,582% 12/6/2029	3.070.642	0,19
USD 8.000	NRG Energy 5,75% 15/1/2028	7.605	0,00	USD 6.000	Post 4,625% 15/4/2030	5.321	0,00
USD 62.000	NuStar Logistics 5,75% 1/10/2025	60.838	0,00	USD 77.000	Post 5,625% 15/1/2028	74.307	0,01
USD 2.200.000	Occidental Petroleum 8,5% 15/7/2027	2.370.648	0,15	USD 200.000	PRA Health Sciences 2,875% 15/7/2026	182.089	0,01
USD 1.330.000	Oncor Electric Delivery 4,3% 15/5/2028	1.288.550	0,08	USD 6.000	Presidio 4,875% 1/2/2027	5.611	0,00
USD 740.000	ONE Gas 1,1% 11/3/2024	721.378	0,05	USD 3.000	Prime Healthcare Services 7,25% 1/11/2025	2.814	0,00
USD 7.000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	5.459	0,00				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 34.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5,25% 15/4/2024	33.768	0,00	USD 4.000	Sensata Technologies 4,375% 15/2/2030	3.541	0,00
USD 51.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5,75% 15/4/2026	50.114	0,00	USD 103.494	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 3,5% 25/8/2047	94.941	0,01
USD 45.000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6,25% 15/1/2028	43.033	0,00	USD 15.000	Service Properties Trust 7,5% 15/9/2025	14.894	0,00
EUR 1.084.000	Procter & Gamble 3,25% 2/8/2026	1.167.548	0,07	USD 739.200	Sesac Finance 5,216% 25/7/2049	700.647	0,04
USD 3.085.000	Prologis 4,875% 15/6/2028	3.048.755	0,19	USD 243.000	Sherwin-Williams 4,25% 8/8/2025	237.448	0,02
USD 39.000	PTC 3,625% 15/2/2025	37.722	0,00	USD 72.000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4,625% 1/11/2026	67.386	0,01
USD 1.160.000	Public Storage Operating 5,125% 15/1/2029	1.155.951	0,07	USD 160.000	Simon Property 3,3% 15/1/2026	152.504	0,01
USD 59.000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4,5% 15/9/2026	46.090	0,00	USD 376.000	Simon Property 3,5% 1/9/2025	362.130	0,02
USD 40.000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4,875% 1/11/2026	37.535	0,00	USD 20.000	Sirius XM Radio 3,125% 1/9/2026	17.964	0,00
USD 177.000	Realty Income 2,2% 15/6/2028	153.657	0,01	USD 50.000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	46.171	0,00
USD 175.000	Realty Income 3,4% 15/1/2028	162.276	0,01	USD 36.000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	36.023	0,00
USD 43.000	Regal Rexnord 6,05% 15/4/2028	42.568	0,00	USD 26.000	SLM 3,125% 2/11/2026	23.165	0,00
USD 57.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,5% 15/2/2029	49.917	0,00	USD 4.422.878	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A 5,862% 15/12/2038	4.288.689	0,27
USD 41.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4,75% 15/10/2027	38.067	0,00	USD 3.070.650	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 5,882% 15/6/2039	2.976.602	0,18
USD 29.000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 7,25% 15/7/2028	29.171	0,00	USD 3.199.343	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 5,842% 15/6/2039	3.073.518	0,19
USD 8.000	Ritchie Bros 6,75% 15/3/2028	8.065	0,00	USD 1.705.729	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 5,822% 15/12/2039	1.639.590	0,10
USD 82.000	RLJ Lodging Trust 3,75% 1/7/2026	75.206	0,01	USD 846.443	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 5,792% 16/12/2041	819.524	0,05
USD 4.000	Rockcliff Energy II 5,5% 15/10/2029	3.688	0,00	USD 3.519.576	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10,175% 15/10/2041	3.724.675	0,23
USD 95.000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2,875% 15/10/2026	84.527	0,00	USD 772.560	SLM Student Loan Trust 2013-4 5,952% 25/6/2027	765.607	0,05
USD 16.000	Rockies Express Pipeline 4,95% 15/7/2029	14.677	0,00	USD 6.000	SM Energy 5,625% 1/6/2025	5.910	0,00
USD 14.000	Ryan Specialty 4,375% 1/2/2030	12.538	0,00	USD 22.000	SM Energy 6,5% 15/7/2028	21.470	0,00
USD 207.000	Ryder System 1,75% 1/9/2026	186.040	0,01	USD 3.000	SM Energy 6,625% 15/1/2027	2.978	0,00
USD 2.043.000	Ryder System 2,85% 1/3/2027	1.879.359	0,12	USD 44.000	SM Energy 6,75% 15/9/2026	43.799	0,00
USD 198.000	Ryder System 2,9% 1/12/2026	182.300	0,01	USD 1.083.287	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 6,325% 15/9/2034	1.078.966	0,07
USD 1.500.000	Ryder System 3,65% 18/3/2024	1.481.903	0,09	USD 635.958	SMB Private Education Loan Trust 2017-B 6,175% 15/10/2035	631.631	0,04
USD 141.000	Ryder System 4,3% 15/6/2027	135.752	0,01	USD 204.600	SMB Private Education Loan Trust 2019-A 3,44% 15/7/2036	195.231	0,01
USD 397.000	Sabine Pass Liquefaction 5,75% 15/5/2024	396.247	0,03	USD 397.371	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 6,255% 15/9/2037	393.880	0,03
USD 51.000	Sabre GLBL 7,375% 1/9/2025	50.179	0,00	USD 3.697.471	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 1,6% 15/9/2054	3.294.259	0,20
USD 5.000	Sabre GLBL 9,25% 15/4/2025	4.931	0,00	USD 950.000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2,31% 15/1/2053	859.961	0,05
USD 3.745.000	San Diego Gas & Electric 4,95% 15/8/2028	3.709.420	0,23	USD 1.312.205	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 6,155% 15/1/2053	1.284.009	0,08
USD 120.000	Santander USA 3,5% 7/6/2024	117.526	0,01	USD 2.306.280	SMB Private Education Loan Trust 2021-C 1,39% 15/1/2053	2.006.293	0,12
USD 59.000	SBA Communications 3,125% 1/2/2029	50.475	0,00	USD 4.375.109	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 6,639% 16/2/2055	4.358.184	0,27
USD 61.000	SBA Communications 3,875% 15/2/2027	56.482	0,00				
USD 10.000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6,625% 1/3/2030	8.824	0,00				
USD 3.000	Sealed Air 5% 15/4/2029	2.782	0,00				
USD 106.000	Sealed Air 5,5% 15/9/2025	104.511	0,01				
USD 14.000	Sealed Air/Sealed Air US 6,125% 1/2/2028	13.826	0,00				
USD 1.633.700	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 3,5% 25/8/2057	1.527.943	0,09				
USD 2.735.013	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2019-4 3% 25/2/2059	2.486.327	0,15				
USD 1.282.000	Sempra 3,3% 1/4/2025	1.235.238	0,08				

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 1.905.335	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4,48% 16/5/2050	1.827.770	0,11	USD 9.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	8.613	0,00
USD 1.831.595	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 7,039% 16/5/2050	1.848.032	0,11	USD 2.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7,5% 1/10/2025	2.005	0,00
USD 9.615.401	SMB Private Education Loan Trust 2022-D 6,989% 15/10/2058	9.695.587	0,60	USD 25.000	Taylor Morrison Communities 5,875% 15/6/2027	24.589	0,00
USD 151.000	Smyrna Ready Mix Concrete 6% 1/11/2028	144.943	0,01	USD 101.000	TCI Communications 7,125% 15/2/2028	108.459	0,01
USD 744.503	SoFi Professional Loan Program 2017-D 2,65% 25/9/2040	709.962	0,04	USD 4.000	TEGNA 4,75% 15/3/2026	3.815	0,00
USD 659.327	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2,84% 25/1/2041	634.592	0,04	USD 72.000	Teleflex 4,25% 1/6/2028	66.299	0,01
USD 1.144.537	SoFi Professional Loan Program 2018-B Trust 3,34% 25/8/2047	1.108.290	0,07	USD 71.000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	61.238	0,01
USD 1.149.533	SoFi Professional Loan Program 2018-C Trust 3,59% 25/1/2048	1.105.535	0,07	USD 80.000	Tenet Healthcare 4,625% 15/6/2028	73.727	0,01
USD 1.081.200	SoFi Professional Loan Program 2018-D Trust 3,6% 25/2/2048	1.036.050	0,06	USD 52.000	Tenet Healthcare 4,875% 1/1/2026	50.448	0,00
USD 1.515.000	Sonoco Products 2,25% 1/2/2027	1.353.919	0,08	USD 2.000	Tenet Healthcare 5,125% 1/11/2027	1.907	0,00
USD 219.000	Sotheby's 7,375% 15/10/2027	199.461	0,01	USD 30.000	Tenet Healthcare 6,125% 15/6/2030	29.093	0,00
USD 24.979	Soundview Home Loan Trust 2003-2 6,729% 25/11/2033	24.523	0,00	USD 31.000	Tenet Healthcare 6,25% 1/2/2027	30.580	0,00
USD 4.291.000	Southern 4,475% 1/8/2024	4.240.894	0,26	USD 20.000	Tenneco 8% 17/11/2028	16.457	0,00
USD 23.000	Specialty Building Products / SBP Finance 6,375% 30/9/2026	21.879	0,00	USD 1.213.607	Texas Electric Market Stabilization Funding N 4,265% 1/8/2034	1.153.097	0,07
USD 878.000	Spectra Energy Partners 3,5% 15/3/2025	847.047	0,05	EUR 461.000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/4/2025	485.255	0,03
USD 6.000	Spirit AeroSystems 7,5% 15/4/2025	5.929	0,00	USD 272.000	TK Elevator US Newco 5,25% 15/7/2027	256.260	0,02
USD 64.000	Spirit AeroSystems 9,375% 30/11/2029	66.661	0,00	USD 136.000	T-Mobile USA 1,5% 15/2/2026	123.875	0,01
USD 3.900.000	Sprint 7,125% 15/6/2024	3.932.577	0,24	USD 88.000	T-Mobile USA 2,05% 15/2/2028	76.782	0,01
USD 1.301.562	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4,738% 20/3/2025	1.288.345	0,08	USD 3.475.000	T-Mobile USA 2,25% 15/2/2026	3.215.024	0,20
USD 139.000	SRS Distribution 4,625% 1/7/2028	123.989	0,01	USD 2.181.000	T-Mobile USA 2,625% 15/4/2026	2.025.848	0,13
USD 140.000	SS&C Technologies 5,5% 30/9/2027	135.048	0,01	USD 3.439.000	T-Mobile USA 3,75% 15/4/2027	3.257.563	0,20
USD 37.000	Standard Industries 4,375% 15/7/2030	31.539	0,00	USD 66.000	Tri Pointe Homes 5,25% 1/6/2027	62.930	0,01
USD 31.000	Standard Industries 4,75% 15/1/2028	28.578	0,00	USD 5.940.000	Truist Financial 6,047% 8/6/2027	5.932.665	0,37
USD 175.000	Standard Industries 5% 15/2/2027	166.486	0,01	USD 40.000	TTMT Escrow Issuer 8,625% 30/9/2027	41.274	0,00
USD 24.000	Staples 7,5% 15/4/2026	19.913	0,00	USD 86.000	Twilio 3,625% 15/3/2029	73.928	0,01
USD 11.000	Starwood Property Trust 4,375% 15/1/2027	9.868	0,00	USD 24.000	Uber Technologies 4,5% 15/8/2029	22.033	0,00
USD 23.000	Starwood Property Trust 5,5% 1/11/2023	22.925	0,00	USD 229.000	Uber Technologies 6,25% 15/1/2028	226.940	0,01
USD 105.000	State Street 3,55% 18/8/2025	101.320	0,01	USD 28.000	Uber Technologies 7,5% 15/5/2025	28.275	0,00
USD 296.000	State Street 5,751% 4/11/2026	296.406	0,02	USD 66.000	Uber Technologies 7,5% 15/9/2027	67.276	0,00
USD 46.000	Station Casinos 4,5% 15/2/2028	41.168	0,00	USD 68.000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	69.288	0,00
USD 34.000	Synaptics 4% 15/6/2029	28.823	0,00	USD 3.191.957	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 3,225% 15/8/2050	2.956.572	0,18
USD 1.873.000	Synchrony Financial 4,875% 13/6/2025	1.804.459	0,11	USD 4.151.000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C5 3,212% 15/11/2050	3.812.577	0,24
USD 15.000	Talen Energy Supply 8,625% 1/6/2030	15.619	0,00	USD 101.000	United Airlines 4,625% 15/4/2029	89.932	0,01
USD 13.000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5,5% 15/1/2028	12.057	0,00	USD 833.057	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5,875% 15/10/2027	831.970	0,05
				USD 142.230	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4,875% 15/1/2026	136.896	0,01
				USD 7.000	United Natural Foods 6,75% 15/10/2028	5.835	0,00
				USD 45.200.000	United States Treasury Note/ Bond 3,5% 15/9/2025*	43.990.547	2,72
				USD 7.060.000	United States Treasury Note/ Bond 3,625% 15/5/2026	6.879.639	0,42
				USD 61.330.000	United States Treasury Note/ Bond 3,75% 15/4/2026	59.954.866	3,71

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 80.465.000	United States Treasury Note/ Bond 3,875% 15/1/2026*	78.893.418	4,88	USD 1.579.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 3,148% 15/5/2048	1.502.259	0,09
USD 36.645.000	United States Treasury Note/ Bond 4% 15/12/2025*	36.025.184	2,23	USD 121.000	WESCO Distribution 7,125% 15/6/2025	121.629	0,01
USD 29.680.000	United States Treasury Note/ Bond 4% 15/2/2026	29.190.744	1,80	USD 4.000	WESCO Distribution 7,25% 15/6/2028	4.061	0,00
USD 32.190.000	United States Treasury Note/ Bond 4,125% 15/6/2026	31.790.140	1,96	USD 503.314	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 3,393% 15/8/2047	499.937	0,03
USD 34.110.000	United States Treasury Note/ Bond 4,25% 15/10/2025	33.698.282	2,08	USD 22.000	William Carter 5,625% 15/3/2027	21.348	0,00
USD 55.000.000	United States Treasury Note/ Bond 4,5% 15/7/2026	54.853.907	3,39	USD 310.000	Williams 4,3% 4/3/2024	307.273	0,02
USD 25.285.000	United States Treasury Note/ Bond 4,5% 15/8/2026	25.145.735	1,55	USD 1.053.000	Williams 5,3% 15/8/2028	1.046.594	0,07
USD 34.125.000	United States Treasury Note/ Bond 4,625% 15/3/2026	34.071.680	2,11	USD 7.302.000	Williams 5,4% 2/3/2026	7.286.419	0,45
USD 79.000.000	United States Treasury Note/ Bond 4,63% 30/6/2025	78.509.336	4,85	USD 93.000	Williams Scotsman International 6,125% 15/6/2025	92.227	0,01
USD 1.164.000	UnitedHealth 4,25% 15/1/2029	1.127.958	0,07	USD 684.000	Workday 3,5% 1/4/2027	646.522	0,04
USD 73.000	Unifi Group / Unifi Finance / CSL Capital 10,5% 15/2/2028	72.759	0,01	USD 154.000	WR Grace 4,875% 15/6/2027	143.819	0,01
USD 59.000	Univision Communications 6,625% 1/6/2027	57.293	0,00	USD 52.000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5,25% 15/5/2027	49.207	0,00
USD 15.000	Univision Communications 7,375% 30/6/2030	14.579	0,00	USD 62.000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5,125% 1/10/2029	55.567	0,00
USD 37.000	Univision Communications 8% 15/8/2028	37.055	0,00	USD 13.000	XPO Escrow Sub 7,5% 15/11/2027	13.232	0,00
USD 2.810.000	US Bancorp 5,775% 12/6/2029	2.801.480	0,17	USD 411.000	Zayo 4% 1/3/2027	309.075	0,02
USD 53.000	US Foods 6,25% 15/4/2025	53.151	0,00	USD 70.000	ZoomInfo Technologies/ ZoomInfo Finance 3,875% 1/2/2029	59.568	0,00
USD 182.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/4/2026	180.256	0,01			1.254.858.146	77,57
USD 2.000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6,875% 1/9/2027	1.952	0,00	Total des obligations		1.544.057.486	95,42
USD 51.000	Vail Resorts 6,25% 15/5/2025	50.883	0,00	BILLET DE TRÉSORERIE			
USD 468.000	Venture Global Calcasieu Pass 3,875% 15/8/2029	405.213	0,03	Canada			
USD 206.000	Venture Global LNG 8,125% 1/6/2028	207.622	0,01	USD 5.500.000	Suncor Energy 0% 1/11/2023	5.446.417	0,34
USD 64.000	Veritas US / Veritas Bermuda 7,5% 1/9/2025	52.544	0,00	Royaume-Uni			
USD 1.260.000	Verizon Communications 2,1% 22/3/2028	1.100.029	0,07	USD 8.000.000	NatWest Markets 0% 26/2/2024	7.772.600	0,48
USD 150.000	Verizon Communications 2,625% 15/8/2026	139.443	0,01	États-Unis			
USD 86.000	Vertiv 4,125% 15/11/2028	77.294	0,01	USD 5.450.000	AT&T 0% 21/2/2024	5.298.248	0,33
USD 9.000	Viasat 5,625% 15/9/2025	8.500	0,00	USD 6.000.000	Enel Finance America 0% 1/9/2023	5.998.182	0,37
USD 30.000	Viasat 5,625% 15/4/2027	26.811	0,00	USD 5.000.000	General Motors Financial 0% 16/10/2023	4.962.687	0,31
USD 1.626.000	VICI Properties 4,375% 15/5/2025	1.580.414	0,10	USD 6.000.000	Harley-Davidson Bank 0% 14/11/2023	5.925.457	0,36
USD 1.487.000	Virginia Electric and Power 3,75% 15/5/2027	1.419.623	0,09	USD 2.250.000	HSBC USA 0% 24/6/2024	2.137.482	0,13
USD 90.000	Vistra Operations 5,625% 15/2/2027	86.719	0,01	USD 5.000.000	HSBC USA 0% 22/8/2024	4.698.087	0,29
USD 2.566.000	VMware 1,4% 15/8/2026	2.272.202	0,14			29.020.143	1,79
USD 2.880.000	VMware 3,9% 21/8/2027	2.711.435	0,17	Total des billets de trésorerie		42.239.160	2,61
USD 52.000	Wabash National 4,5% 15/10/2028	44.138	0,00	CERTIFICATS DE DÉPÔT			
USD 2.800.000	WEC Energy 4,75% 9/1/2026	2.760.731	0,17	États-Unis			
USD 3.639.000	Wells Fargo 3,526% 24/3/2028	3.384.578	0,21	USD 7.000.000	Citibank (New York Branch) 5% 21/9/2023	6.997.401	0,43
USD 910.000	Wells Fargo 4,808% 25/7/2028	882.502	0,06	Total des certificats de dépôt		6.997.401	0,43
USD 4.960.000	Wells Fargo 5,574% 25/7/2029	4.936.211	0,31	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
USD 3.975.000	Wells Fargo Bank 5,45% 7/8/2026	3.991.227	0,25			1.593.294.047	98,46
USD 540.135	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 3,477% 15/8/2050	535.288	0,03	Total du portefeuille		1.593.294.047	98,47
				Autres éléments de l'actif net			
						24.828.531	1,53
				Total de l'actif net (USD)			
						1.618.122.578	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
EUR	11.757.561	USD	12.852.649	Société Générale	20/9/2023	(86.455)
EUR	6.227.000	USD	6.814.173	UBS	20/9/2023	(52.984)
EUR	10.888.000	USD	11.948.226	JP Morgan	20/9/2023	(126.189)
EUR	601.000	USD	663.845	BNY Mellon	20/9/2023	(11.288)
EUR	271.000	USD	293.290	Morgan Stanley	20/9/2023	958
GBP	2.674.000	USD	3.401.540	Toronto-Dominion	20/9/2023	(11.598)
GBP	1.015.425	USD	1.291.424	Goldman Sachs	20/9/2023	(4.127)
GBP	23.374.000	USD	29.671.082	HSBC Bank	20/9/2023	(38.874)
GBP	2.395.000	USD	3.059.968	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(23.725)
GBP	1.800.000	USD	2.317.730	Barclays	20/9/2023	(35.794)
GBP	994.000	USD	1.269.368	RBS	20/9/2023	(9.232)
GBP	463.000	USD	583.929	BNY Mellon	20/9/2023	3.036
JPY	72.096.000	USD	496.207	Morgan Stanley	20/9/2023	(1.657)
USD	2.625.854	EUR	2.424.000	Deutsche Bank	20/9/2023	(6.091)
USD	366.986	EUR	340.000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(2.181)
USD	15.720.685	EUR	14.595.304	JP Morgan	20/9/2023	(126.691)
USD	4.532.911	GBP	3.610.000	JP Morgan	20/9/2023	(43.638)
USD	86.586.632	GBP	67.525.000	BNP Paribas	20/9/2023	982.336
USD	60.918.891	EUR	55.513.133	BNP Paribas	20/9/2023	643.512
USD	34.577.169	EUR	31.504.867	Toronto-Dominion	20/9/2023	369.628
USD	605.597	GBP	474.000	State Street	20/9/2023	4.687
USD	2.076.799	EUR	1.850.000	Barclays	20/9/2023	68.095
USD	1.325.840	GBP	1.038.790	HSBC Bank	20/9/2023	8.922
Plus-value nette non réalisée						1.500.650
Catégorie d'Actions couverte en CNY						
CNY	35.938	USD	4.981	BNY Mellon	15/9/2023	(38)
Moins-value nette non réalisée						(38)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	263.977.437	USD	289.669.585	BNY Mellon	15/9/2023	(3.114.294)
USD	33.697.155	EUR	31.001.885	BNY Mellon	15/9/2023	43.865
Moins-value nette non réalisée						(3.070.429)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	1.674.032	USD	1.243.697	BNY Mellon	15/9/2023	(4.624)
Moins-value nette non réalisée						(4.624)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 602.855.034)						(1.574.441)

Contrats à terme ouverts négociés en bourse au 31 août 2023

Nombre de contrats	Devise	Contrat/ Description	Date d'expiration	Exposition sous-jacente USD	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
(5)	EUR	Euro Bund	Septembre 2023	721.489	2.929
(23)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	Septembre 2023	23.125.111	148.319
(101)	EUR	Euro BOBL	Décembre 2023	12.861.342	(44.927)
(96)	EUR	Euro Schatz	Décembre 2023	10.981.555	(16.144)
(59)	USD	US Long Bond (CBT)	Décembre 2023	7.172.187	(74.679)
40	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	Décembre 2023	4.435.625	23.851
(487)	USD	US Ultra 10 Year Note	Décembre 2023	56.484.391	(440.578)
(12)	USD	US Ultra Bond (CBT)	Décembre 2023	1.553.625	(28.300)
2.794	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Décembre 2023	569.059.216	509.383
(2.070)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Décembre 2023	221.085.702	(1.617.185)
Total				907.480.243	(1.537.331)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Dollar Short Duration Bond Fund suite

Swaps au 31 août 2023

Type	Valeur nominale	Description	Contrepartie	Date d'expiration	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD	Valeur de marché USD
CDS	USD 6.130.000	Fund receives default protection on CDX.NA.HY.40.V1; and pays Fixed 5%	Bank of America	20/6/2028	2.554	(181.375)
CDS	USD 38.590.000	Fund receives default protection on CDX.NA.IG.40; and pays Fixed 1%	Bank of America	20/6/2028	(263.748)	(609.428)
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 45.631.595)					(261.194)	(790.803)

CDS : Swaps sur défaillance (Credit Default Swaps)

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 16.655.000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	15.372.762	0,95
USD 18.555.000	Fannie Mae or Freddie Mac 4,5% TBA	17.596.864	1,09
USD 16.215.000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	15.726.308	0,97
Total TBA (USD Exposition sous-jacente - USD 48.695.934)		48.695.934	3,01

US Flexible Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				105.456	FleetCor Technologies	28.993.018	1,54
ACTIONS ORDINAIRES				517.110	Fortive	40.944.770	2,18
Bermudes				142.895	Fortrea	3.916.752	0,21
809.079	Axalta Coating Systems	23.155.841	1,23	441.183	Fox*	14.761.983	0,79
Danemark				761.309	General Motors	25.534.304	1,36
195.952	Novo Nordisk	36.462.748	1,94	47.558	Humana	22.435.486	1,19
France				283.766	Intercontinental Exchange	33.481.551	1,78
734.485	Sanofi*	39.691.569	2,11	208.571	JPMorgan Chase	30.828.880	1,63
Irlande				142.108	Laboratory of America	30.220.688	1,60
182.897	Allegion	20.875.864	1,11	329.582	Las Vegas Sands	18.242.364	0,97
396.230	Medtronic	32.669.163	1,74	106.490	LPL Financial	24.894.167	1,32
				400.911	Marvell Technology*	23.449.284	1,25
				162.723	Meta Platforms	48.598.851	2,58
				422.063	Microsoft	138.884.051	7,38
				439.539	Mondelez International	31.308.363	1,66
				351.812	Monster Beverage	20.320.661	1,09
				229.298	Otis Worldwide	19.850.328	1,05
				150.505	Progressive	20.193.256	1,07
Japon				124.622	Reinsurance of America	17.422.156	0,93
332.640	Sony*	27.668.995	1,47	279.109	Ross Stores	33.989.894	1,80
Jersey				341.398	Skechers USA	17.117.696	0,91
276.338	Aptiv	28.150.552	1,49	303.638	Tenet Healthcare	23.796.110	1,27
Royaume-Uni				78.926	UnitedHealth	38.673.740	2,05
728.966	BP	27.183.142	1,44	99.609	Veeva Systems	20.393.947	1,08
772.788	Shell	23.702.020	1,26	46.108	Visa*	11.387.292	0,61
439.661	Unilever*	22.695.301	1,21	235.752	Voya Financial	16.787.900	0,89
				183.218	World Wrestling Entertainment*	19.789.377	1,05
				59.030	Zebra Technologies	16.451.661	0,87
						1.573.391.665	83,61
				Total des actions ordinaires		1.855.646.860	98,61
États-Unis				Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
269.520	Advanced Micro Devices	28.946.448	1,54			1.855.646.860	98,61
397.742	Alphabet	54.387.241	2,88	Autres titres négociables			
293.472	Alphabet	40.449.245	2,15	ACTIONS ORDINAIRES			
686.264	Amazon.com	94.539.729	5,03	États-Unis			
123.259	Analog Devices	22.449.162	1,19	28.100	World Access	-	0,00
431.145	Apple	81.081.128	4,31	Total des actions ordinaires			
305.465	Applied Materials	46.415.407	2,47	-			
1.137.052	Avantor*	25.071.997	1,33	Total des autres valeurs mobilières			
144.543	Berkshire Hathaway	52.229.167	2,78	-			
96.996	Caterpillar	27.424.649	1,46	Total du portefeuille			
644.858	Ciena*	31.630.285	1,68	1.855.646.860			
498.811	Cognizant Technology Solutions	35.759.761	1,90	Autres éléments de l'actif net			
1.310.078	Comcast*	61.914.286	3,29	26.100.891			
280.240	ConocoPhillips	33.300.919	1,77	Total de l'actif net (USD)			
715.494	Corteva	36.561.743	1,94	1.881.747.751			
174.026	Dollar General*	22.821.769	1,21	100,00			
167.368	Dollar Tree	20.311.780	1,08				
1.940.154	Dun & Bradstreet*	21.167.080	1,13				
48.408	Elevance Health	22.103.093	1,18				
538.475	Fidelity National Financial	22.158.246	1,18				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

US Flexible Equity Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	2.237.832	USD	309.521	BNY Mellon	15/9/2023	(1.753)
USD	15.838	CNY	115.160	BNY Mellon	15/9/2023	(1)
Moins-value nette non réalisée						(1.754)
Catégorie d'Actions couverte en CZK						
CZK	111.073	USD	5.011	BNY Mellon	15/9/2023	(4)
USD	278	CZK	6.138	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(4)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	161.048.464	USD	176.570.442	BNY Mellon	15/9/2023	(1.747.663)
USD	23.407.755	EUR	21.476.636	BNY Mellon	15/9/2023	94.313
Moins-value nette non réalisée						(1.653.350)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	4.101	USD	5.217	BNY Mellon	15/9/2023	(18)
USD	288	GBP	228	BNY Mellon	15/9/2023	-
Moins-value nette non réalisée						(18)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	871.497	USD	6.113	BNY Mellon	15/9/2023	(139)
USD	338	JPY	48.978	BNY Mellon	15/9/2023	2
Moins-value nette non réalisée						(137)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 198.370.756)						(1.655.263)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	23,19
Technologie	21,99
Communications	19,45
Finance	12,19
Biens de consommation cyclique	10,29
Valeurs industrielles	5,80
Énergie	4,47
Matériaux de base	1,23
Autres éléments de l'actif net	1,39
	100,00

US Government Mortgage Impact Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 294.747	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/11/2050	249.946	0,29	USD 197.600	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2050	174.407	0,20
USD 19.826	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/1/2051	17.259	0,02	USD 223.498	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2050	197.416	0,23
USD 21.662	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/1/2051	18.255	0,02	USD 433.947	Ginnie Mae II Pool 3% 20/11/2050	383.420	0,44
USD 2.325.982	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/3/2051	2.005.152	2,30	USD 362.959	Ginnie Mae II Pool 3% 20/11/2050	320.488	0,37
USD 2.299.874	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/3/2051	1.980.087	2,27	USD 268.688	Ginnie Mae II Pool 3% 20/11/2050	236.502	0,27
USD 559.366	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/4/2051	484.860	0,56	USD 21.919	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2050	19.435	0,02
USD 17.107	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/4/2051	14.507	0,02	USD 22.027	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2050	19.323	0,02
USD 14.836	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/4/2051	12.578	0,01	USD 15.502	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2050	13.682	0,02
USD 644.572	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/4/2051	558.541	0,64	USD 13.918	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2050	12.306	0,01
USD 2.791.787	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/8/2051	2.332.110	2,68	USD 20.510	Ginnie Mae II Pool 3% 20/1/2051	18.134	0,02
USD 6.231.415	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/9/2051	5.176.234	5,94	USD 21.671	Ginnie Mae II Pool 3% 20/1/2051	18.855	0,02
USD 2.134.065	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/9/2051	1.772.695	2,03	USD 14.843	Ginnie Mae II Pool 3% 20/1/2051	13.094	0,02
USD 102.142	Ginnie Mae II Pool 2,5% 20/10/2051	86.587	0,10	USD 18.256	Ginnie Mae II Pool 3% 20/2/2051	16.204	0,02
USD 74.824	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2045	66.094	0,08	USD 19.473	Ginnie Mae II Pool 3% 20/2/2051	17.187	0,02
USD 158.392	Ginnie Mae II Pool 3% 20/11/2045	139.915	0,16	USD 20.645	Ginnie Mae II Pool 3% 20/2/2051	17.962	0,02
USD 15.678	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2046	13.807	0,02	USD 31.740	Ginnie Mae II Pool 3% 20/3/2051	27.615	0,03
USD 452.207	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2050	399.396	0,46	USD 16.005	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	14.157	0,02
USD 1.007.827	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2050	894.918	1,03	USD 18.045	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	15.956	0,02
USD 1.479.882	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2050	1.311.430	1,50	USD 30.454	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	26.899	0,03
USD 1.610.316	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2050	1.417.316	1,63	USD 29.477	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	26.018	0,03
USD 755.474	Ginnie Mae II Pool 3% 20/7/2050	667.266	0,77	USD 31.382	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	27.680	0,03
USD 632.776	Ginnie Mae II Pool 3% 20/7/2050	559.270	0,64	USD 16.162	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2051	14.225	0,02
USD 485.324	Ginnie Mae II Pool 3% 20/8/2050	429.095	0,49	USD 22.927	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2051	20.237	0,02
USD 796.515	Ginnie Mae II Pool 3% 20/8/2050	704.009	0,81	USD 27.714	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2051	24.504	0,03
USD 911.106	Ginnie Mae II Pool 3% 20/8/2050	804.467	0,92	USD 43.644	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2051	38.550	0,04
USD 721.836	Ginnie Mae II Pool 3% 20/8/2050	636.259	0,73	USD 1.380.922	Ginnie Mae II Pool 3% 20/8/2051	1.242.772	1,43
USD 56.494	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	49.935	0,06	USD 1.531.400	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2051	1.377.220	1,58
USD 89.554	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	78.822	0,09	USD 112.517	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2051	99.036	0,11
USD 30.057	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	26.637	0,03	USD 122.268	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	108.073	0,12
USD 63.661	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	55.923	0,06	USD 86.815	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	76.684	0,09
USD 42.320	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	37.500	0,04	USD 93.055	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	82.134	0,09
USD 31.983	Ginnie Mae II Pool 3% 20/9/2050	28.341	0,03	USD 137.153	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	120.719	0,14
USD 267.684	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2050	236.608	0,27	USD 58.605	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	51.691	0,06
USD 124.095	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2050	109.683	0,13	USD 1.204.943	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	1.083.646	1,24
USD 172.298	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2050	152.187	0,17	USD 3.346.924	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2051	3.010.019	3,45
USD 127.827	Ginnie Mae II Pool 3% 20/10/2050	112.514	0,13	USD 42.481	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/4/2043	39.420	0,05

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Government Mortgage Impact Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
USD 29.708	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2043	27.609	0,03	USD 17.236	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2051	15.827	0,02
USD 24.196	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	22.321	0,03	USD 17.514	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2051	16.022	0,02
USD 26.428	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	24.384	0,03	USD 16.827	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2051	15.393	0,02
USD 21.013	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	19.368	0,02	USD 17.295	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2051	15.714	0,02
USD 52.489	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	48.435	0,06	USD 16.034	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	14.667	0,02
USD 33.060	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2046	30.482	0,03	USD 37.354	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2051	33.940	0,04
USD 669.764	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2050	612.634	0,70	USD 861.340	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/7/2051	787.934	0,90
USD 1.233.270	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2050	1.128.130	1,29	USD 383.259	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/8/2051	350.766	0,40
USD 883.113	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/5/2050	808.123	0,93	USD 84.816	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	76.985	0,09
USD 633.204	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2050	581.571	0,67	USD 70.493	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	64.420	0,07
USD 641.452	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2050	586.735	0,67	USD 48.746	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2051	44.546	0,05
USD 344.683	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2050	315.283	0,36	USD 1.096	Ginnie Mae II Pool 4% 20/4/2039	1.047	0,00
USD 720.524	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2050	659.089	0,76	USD 7.434	Ginnie Mae II Pool 4% 20/7/2039	7.102	0,01
USD 461.649	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2050	422.287	0,48	USD 1.801	Ginnie Mae II Pool 4% 20/9/2040	1.722	0,00
USD 1.031.262	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/6/2050	940.783	1,08	USD 59.063	Ginnie Mae II Pool 4% 20/10/2040	56.471	0,06
USD 1.140.866	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/8/2050	1.043.651	1,20	USD 47.971	Ginnie Mae II Pool 4% 20/12/2040	45.862	0,05
USD 921.442	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/8/2050	837.181	0,96	USD 41.699	Ginnie Mae II Pool 4% 20/1/2041	39.868	0,05
USD 39.741	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	36.368	0,04	USD 1.708	Ginnie Mae II Pool 4% 20/2/2041	1.633	0,00
USD 39.495	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	36.763	0,04	USD 22.101	Ginnie Mae II Pool 4% 20/4/2042	21.130	0,02
USD 38.058	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	35.382	0,04	USD 3.655	Ginnie Mae II Pool 4% 20/8/2044	3.457	0,00
USD 21.410	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	19.876	0,02	USD 8.741	Ginnie Mae II Pool 4% 20/8/2044	8.317	0,01
USD 91.339	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/9/2050	82.774	0,09	USD 6.172	Ginnie Mae II Pool 4% 20/8/2044	5.867	0,01
USD 102.893	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2050	94.126	0,11	USD 7.422	Ginnie Mae II Pool 4% 20/10/2046	6.991	0,01
USD 67.601	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2050	61.839	0,07	USD 74.416	Ginnie Mae II Pool 4% 20/3/2047	70.409	0,08
USD 165.765	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2050	150.608	0,17	USD 13.841	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2047	13.107	0,02
USD 80.800	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/10/2050	73.911	0,08	USD 63.019	Ginnie Mae II Pool 4% 20/6/2047	59.666	0,07
USD 21.164	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2050	19.360	0,02	USD 53.081	Ginnie Mae II Pool 4% 20/11/2047	50.141	0,06
USD 29.790	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/12/2050	27.066	0,03	USD 26.101	Ginnie Mae II Pool 4% 20/12/2047	24.679	0,03
USD 19.190	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/1/2051	17.555	0,02	USD 815.661	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2050	763.583	0,88
USD 16.921	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/1/2051	15.587	0,02	USD 912.615	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2050	854.846	0,98
USD 15.431	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/1/2051	14.341	0,02	USD 495.537	Ginnie Mae II Pool 4% 20/8/2050	462.261	0,53
USD 24.544	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/2/2051	22.609	0,03	USD 13.111	Ginnie Mae II Pool 4% 20/3/2051	12.299	0,01
USD 23.840	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/3/2051	21.860	0,03	USD 27.138	Ginnie Mae II Pool 4% 20/3/2051	25.260	0,03
USD 20.085	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/4/2051	18.372	0,02	USD 19.157	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2051	17.934	0,02
USD 21.832	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/4/2051	19.971	0,02	USD 18.580	Ginnie Mae II Pool 4% 20/5/2051	17.325	0,02
USD 33.577	Ginnie Mae II Pool 3,5% 20/4/2051	30.508	0,03	USD 578.825	Ginnie Mae II Pool 4% 20/7/2051	541.771	0,62
				USD 4.176	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/12/2039	4.088	0,00
				USD 5.085	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/1/2040	4.978	0,01
				USD 4.156	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/2/2040	4.069	0,00
				USD 268	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/5/2040	262	0,00
				USD 1.338	Ginnie Mae II Pool 4,5% 20/7/2040	1.308	0,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Government Mortgage Impact Fund suite

Contrats sur titres à déterminer (TBAs) au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché USD	% de l'actif net
TBA			
États-Unis			
USD 13.548.000	Ginnie Mae 2% TBA	11.208.853	12,86
USD 2.533.529	Ginnie Mae 4% TBA	2.358.666	2,71
USD 1.706.000	Ginnie Mae 4,5% TBA	1.625.903	1,87
USD 1.693.000	Ginnie Mae 5% TBA	1.649.052	1,89
USD 1.930.000	Ginnie Mae 5,5% TBA	1.911.467	2,19
USD (5.639.400)	Ginnie Mae 2,5% TBA	(4.808.184)	(5,52)
USD (6.771.526)	Ginnie Mae 3% TBA	(5.958.422)	(6,84)
USD (2.753.476)	Ginnie Mae 3,5% TBA	(2.501.274)	(2,87)
Total TBA			
(USD Exposition sous-jacente - USD 32.021.823)		5.486.061	6,29

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Growth Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				34.780	Intuitive Surgical	11.135.165	2,84
				10.896	Mastercard	4.516.174	1,15
				14.777	Meta Platforms	4.413.299	1,13
				95.057	Microsoft	31.279.456	7,98
				7.856	MSCI	4.282.934	1,09
				21.899	Netflix	9.537.015	2,43
				34.107	NIKE	3.497.673	0,89
				53.712	NVIDIA	26.705.069	6,81
				13.667	Palo Alto Networks	3.303.314	0,84
				15.838	Roper Technologies	7.957.803	2,03
				20.011	S&P Global*	7.869.526	2,01
				11.611	ServiceNow	6.881.608	1,76
				51.130	Tesla	13.152.170	3,35
				22.658	UnitedHealth	11.102.420	2,83
				76.974	Visa*	19.010.269	4,85
				25.223	Zoetis*	4.868.291	1,24
						365.044.991	93,11
				Total des actions ordinaires		391.054.589	99,74
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé		391.054.589	99,74
				Total du portefeuille		391.054.589	99,74
				Autres éléments de l'actif net		1.009.121	0,26
				Total de l'actif net (USD)		392.063.710	100,00
ACTIONS ORDINAIRES							
France							
7.257	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	6.251.517	1,59				
Pays-Bas							
20.157	ASML	13.411.460	3,42				
Suède							
57.900	Evolution*	6.346.621	1,62				
États-Unis							
139.818	Alphabet	19.118.713	4,88				
237.057	Amazon.com	32.656.972	8,33				
163.150	Apple	30.681.989	7,82				
52.538	Blackstone*	5.558.520	1,42				
96.950	Boston Scientific	5.279.897	1,35				
13.980	Broadcom	12.746.545	3,25				
52.486	Cadence Design Systems	12.673.270	3,23				
30.897	Cheniere Energy	5.085.028	1,30				
2.604	Chipotle Mexican Grill	5.056.968	1,29				
254.100	Copart	11.467.533	2,93				
49.065	Danaher	13.076.313	3,34				
21.524	Eli Lilly	11.816.676	3,01				
66.759	HEICO*	11.300.964	2,88				
35.143	Intuit	19.013.417	4,85				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

US Growth Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	20.893.066	USD	22.912.842	BNY Mellon	15/9/2023	(232.812)
USD	1.952.424	EUR	1.789.074	BNY Mellon	15/9/2023	10.339
Moins-value nette non réalisée						(222.473)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 24.609.025)						(222.473)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Technologie	42,24
Communications	17,61
Biens de consommation non cyclique	16,62
Biens de consommation cyclique	11,67
Finance	7,42
Valeurs industrielles	2,88
Énergie	1,30
Autres éléments de l'actif net	0,26
	100,00

US Mid-Cap Value Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

		Valeur de marché (USD)	% de l'actif net			Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Nombre	Description			Nombre	Description		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				2.810	Charles River Laboratories International	590.662	0,24
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES				9.986	Cheniere Energy	1.643.496	0,68
Australie				29.497	Ciena*	1.446.828	0,59
53.860	Woodside Energy*	1.294.256	0,53	5.746	Cigna	1.616.062	0,66
Bermudes				44.370	Citigroup	1.842.686	0,75
63.361	Axalta Coating Systems*	1.813.392	0,75	89.813	Cognizant Technology Solutions	6.438.694	2,65
Canada				4.938	Constellation Brands	1.285.411	0,53
70.247	Barrick Gold	1.149.943	0,47	26.822	Crown	2.492.837	1,02
119.632	Gildan Activewear*	3.609.298	1,48	11.449	Crown Castle	1.158.524	0,48
7.974	Onex	494.081	0,20	20.990	Denbury*	1.922.684	0,79
73.540	Suncor Energy*	2.501.095	1,03	20.670	Dollar General	2.710.664	1,11
		7.754.417	3,18	30.585	Dollar Tree	3.711.796	1,53
Finlande				198.523	Dun & Bradstreet*	2.165.886	0,89
504.783	Nokia*	2.019.132	0,83	82.684	DXC Technology	1.711.972	0,70
Allemagne				20.016	Edison International	1.404.323	0,58
54.798	Bayer	3.027.338	1,24	20.935	Entergy	2.028.601	0,83
14.184	Henkel	1.092.301	0,45	94.971	Equitable	2.779.801	1,14
5.192	MTU Aero Engines	1.222.369	0,50	44.800	Exelon	1.817.088	0,75
		5.342.008	2,19	4.850	F&G Annuities & Life	142.639	0,06
Irlande				84.748	Fidelity National Financial	3.487.380	1,43
21.805	Allegion	2.488.822	1,02		Fidelity National Information Services	4.753.747	1,95
11.953	CRH	691.003	0,29	3.808	First Citizens BancShares*	5.191.446	2,13
12.584	Willis Towers Watson	2.627.917	1,08	11.510	Fortive	911.362	0,37
		5.807.742	2,39	68.376	Fortrea	1.874.186	0,77
Japon				107.598	Fox*	3.600.229	1,48
131.400	Komatsu	3.731.040	1,53	19.933	Fulgent Genetics*	676.127	0,28
151.100	Panasonic	1.736.324	0,72	114.004	General Motors	3.823.694	1,57
		5.467.364	2,25	82.962	Goodyear Tire & Rubber*	1.077.676	0,44
Pays-Bas				17.188	Hasbro	1.238.567	0,51
33.645	Koninklijke Philips*	761.087	0,31	4.266	Hess	657.006	0,27
107.290	Koninklijke Philips	2.420.999	1,00	9.641	Howard Hughes	763.567	0,31
		3.182.086	1,31	40.508	HP	1.190.125	0,49
Singapour				23.527	Huntington Ingalls Industries	5.214.289	2,14
84.412	Flex	2.352.140	0,97	30.395	International Flavors & Fragrances	2.158.957	0,89
Royaume-Uni				19.803	International Paper	691.322	0,28
49.485	BAE Systems*	634.701	0,26	93.687	Kinder Morgan	1.626.875	0,67
50.333	BP	1.876.917	0,77	295.791	Kosmos Energy*	2.171.106	0,89
107.701	British American Tobacco*	3.619.831	1,49	180.048	Kraft Heinz	5.968.591	2,45
184.440	Prudential*	2.300.813	0,94	19.276	Laboratory of America	4.099.234	1,69
1.356.770	Vodafone	1.266.541	0,52	29.794	Las Vegas Sands	1.649.098	0,68
		9.698.803	3,98	15.424	Lear	2.253.138	0,93
États-Unis				65.464	Leidos	6.456.060	2,65
13.428	Activision Blizzard	1.235.376	0,51	2.867	LPL Financial	670.219	0,28
17.450	Advance Auto Parts	1.195.849	0,49	95.321	Mattel	2.119.939	0,87
19.942	Allstate	2.171.883	0,89	10.479	Mid-America Apartment Communities	1.528.781	0,63
30.810	American Electric Power*	2.451.552	1,01	19.101	MSC Industrial Direct*	1.948.875	0,80
46.129	American International	2.695.317	1,11	21.660	NCR*	666.045	0,27
9.010	Apollo Global Management	779.185	0,32	115.121	Newell Brands*	1.212.800	0,50
14.083	Assurant*	1.957.960	0,80	117.177	PG&E*	1.935.764	0,79
8.900	AvalonBay Communities	1.642.851	0,68	30.547	Public Service Enterprise	1.891.470	0,78
81.839	Avantor*	1.804.550	0,74	20.255	Ralph Lauren*	2.338.237	0,96
50.786	Avnet	2.597.196	1,07	29.976	Raymond James Financial	3.144.183	1,29
97.532	Baxter International	4.037.825	1,66	3.460	Repligen*	598.061	0,25
167.298	Cannae	3.272.349	1,35	16.224	Robert Half	1.221.992	0,50
50.244	Cardinal Health	4.439.560	1,82	18.659	Ross Stores	2.272.293	0,93
82.069	Carlyle	2.660.677	1,09	137.807	Sealed Air	5.137.445	2,11
24.929	Catalent	1.246.201	0,51	28.746	Sempra	2.050.165	0,84
10.384	Cencora	1.845.548	0,76	97.171	SS&C Technologies*	5.627.173	2,31
				67.960	Telephone and Data Systems	1.431.917	0,59
				187.221	Under Armour*	1.435.985	0,59
				2.925	Veeva Systems	598.864	0,25
				117.318	Warner Bros Discovery*	1.550.358	0,64
				36.545	Wells Fargo*	1.522.830	0,63
				1.542	West Pharmaceutical Services	631.742	0,26

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Mid-Cap Value Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
116.547	Western Digital	5.294.730	2,17
4.676	Zebra Technologies	1.303.201	0,54
25.576	Zimmer Biomet	3.080.118	1,27
		187.691.502	77,11
	Total des actions ordinaires et privilégiées	232.422.842	95,49
	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé	232.422.842	95,49
	Total du portefeuille	232.422.842	95,49
	Autres éléments de l'actif net	10.967.309	4,51
	Total de l'actif net (USD)	243.390.151	100,00

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Moins-value non réalisée USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	2.304.246	USD	1.498.699	BNY Mellon	15/9/2023	(5.513)
USD	314.961	AUD	487.262	BNY Mellon	15/9/2023	(792)
						(6.305)
						(6.305)
						(6.305)
						(6.305)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Biens de consommation non cyclique	19,77
Finance	17,59
Technologie	14,49
Biens de consommation cyclique	14,11
Valeurs industrielles	11,28
Énergie	5,63
Services aux collectivités	5,58
Communications	4,65
Matériaux de base	2,39
Autres éléments de l'actif net	4,51
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

US Sustainable Equity Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net		
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				1.441	CBRE	123.220	2,56		
ACTIONS ORDINAIRES				370	Charles River Laboratories International	77.774	1,61		
France				883	Charles Schwab	52.724	1,09		
160	Kering	86.527	1,80	1.051	Dollar Tree	127.549	2,65		
272	L'Oreal	121.111	2,51	298	Elevance Health	136.067	2,83		
		207.638	4,31	1.915	First American Financial	117.121	2,43		
Irlande				165	Humana	77.839	1,62		
430	Willis Towers Watson	89.797	1,86	340	Intuit	183.950	3,82		
Pays-Bas				1.373	Microsoft	451.799	9,38		
213	ASML	141.719	2,94	519	NIKE	53.224	1,10		
Suisse				310	NVIDIA	154.129	3,20		
2.121	Alcon	178.189	3,70	178	Roper Technologies	89.436	1,86		
140	Lonza	77.925	1,62	328	S&P Global	128.989	2,68		
		256.114	5,32	2.573	Sealed Air	95.921	1,99		
Royaume-Uni				330	Sherwin-Williams	89.681	1,86		
2.384	AstraZeneca	164.043	3,41	660	Union Pacific	146.857	3,05		
1.753	Reckitt Benckiser	127.687	2,65	944	Visa*	233.140	4,84		
		291.730	6,06	1.740	Wells Fargo	72.506	1,51		
États-Unis				1.901	Western Digital	86.363	1,79		
2.179	Alphabet	297.956	6,19	556	Xylem	57.868	1,20		
2.606	Amazon.com	359.003	7,45			3.782.471	78,52		
657	Applied Materials	99.831	2,07	Total des actions ordinaires			4.769.469	99,01	
2.383	Bank of America	68.928	1,43	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				4.769.469	99,01
120	Broadcom	109.413	2,27	Total du portefeuille				4.769.469	99,01
481	Cadence Design Systems	116.142	2,41	Autres éléments de l'actif net				47.884	0,99
1.981	Cardinal Health	175.041	3,63	Total de l'actif net (USD)				4.817.353	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

US Sustainable Equity Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Technologie	29,74
Biens de consommation non cyclique	26,26
Finance	15,72
Communications	13,64
Valeurs industrielles	6,24
Biens de consommation cyclique	5,55
Matériaux de base	1,86
Autres éléments de l'actif net	0,99
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

World Energy Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				215.333	Darling Ingredients	13.565.979	0,45	
				606.123	Diamondback Energy	91.621.553	3,07	
				1.070.294	EOG Resources	136.965.523	4,58	
				2.289.985	Exxon Mobil	253.821.938	8,49	
				903.413	Hess	139.134.636	4,65	
				4.957.168	Kinder Morgan	86.081.222	2,88	
				3.419.904	Kosmos Energy*	25.102.095	0,84	
				923.182	Marathon Petroleum	130.777.962	4,37	
				362.700	NOV*	7.634.835	0,26	
				776.794	Valero Energy*	100.517.144	3,36	
				3.838.259	Williams	133.897.665	4,48	
		423.074.891	14,15			1.587.269.297	53,08	
	Curaçao			Total des actions ordinaires			2.961.862.994	99,06
2.397.184	Schlumberger	141.050.307	4,72	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				
	France					2.961.862.994	99,06	
4.213.428	TotalEnergies*	265.960.479	8,90	Autres titres négociables				
	Irlande			ACTIONS ORDINAIRES				
88.550	Weatherford International	7.739.270	0,26	Fédération de Russie				
	Italie			6.776.700	Gazprom**	706	0,00	
4.743.694	Eni*	74.173.493	2,48	États-Unis				
	Luxembourg			4.502.180	Caithness Petroleum**	-	0,00	
454.900	Tenaris	7.388.317	0,25	Total des actions ordinaires			706	0,00
	Royaume-Uni			Total des autres valeurs mobilières			706	0,00
25.200.483	BP	156.676.177	5,24	Total du portefeuille			2.961.863.700	99,06
8.981.074	Shell	275.456.650	9,21	Autres éléments de l'actif net			28.220.371	0,94
1.213.150	TechnipFMC	23.074.113	0,77	Total de l'actif net (USD)			2.990.084.071	100,00
		455.206.940	15,22					
	États-Unis							
870.710	Cheniere Energy	143.301.452	4,79					
892.945	Chevron	143.585.556	4,80					
1.525.387	ConocoPhillips	181.261.737	6,06					

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

World Energy Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	17.207.288	USD	11.203.258	BNY Mellon	15/9/2023	(52.675)
USD	1.385.866	AUD	2.129.983	BNY Mellon	15/9/2023	5.606
Moins-value nette non réalisée						(47.069)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	4.366.339	USD	4.998.205	BNY Mellon	15/9/2023	(48.515)
USD	380.252	CHF	332.894	BNY Mellon	15/9/2023	2.884
Moins-value nette non réalisée						(45.631)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	154.217.368	USD	169.171.696	BNY Mellon	15/9/2023	(1.764.227)
USD	12.148.968	EUR	11.134.987	BNY Mellon	15/9/2023	61.648
Moins-value nette non réalisée						(1.702.579)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	46.893.571	USD	6.003.680	BNY Mellon	15/9/2023	(21.405)
USD	437.411	HKD	3.421.912	BNY Mellon	15/9/2023	873
Moins-value nette non réalisée						(20.532)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	162.536	SGD	220.043	BNY Mellon	5/9/2023	(260)
SGD	103.245.096	USD	76.686.674	BNY Mellon	15/9/2023	(267.508)
USD	6.895.493	SGD	9.321.170	BNY Mellon	15/9/2023	(3.764)
Moins-value nette non réalisée						(271.532)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 287.101.447)						(2.087.343)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Producteurs de pétrole et de gaz	78,43
Pipelines	14,18
Services pétroliers et gaziers	5,75
Agriculture	0,45
Métal/Matériel	0,25
Autres éléments de l'actif net	0,94
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

World Financials Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES							
Autriche				Suède			
702.196	BAWAG	33.109.749	1,85	4.152.361	Hoist Finance	11.266.584	0,63
826.061	Erste Bank	30.014.774	1,67	Suisse			
		63.124.523	3,52	2.089.686	UBS	55.814.295	3,12
Brésil				Royaume-Uni			
2.152.286	Banco do Brasil	20.649.889	1,15	11.000.000	Cab Payments*	38.625.296	2,16
1.685.706	IRB-Brasil Resseguros	15.232.428	0,85	9.034.509	HSBC	67.123.661	3,75
		35.882.317	2,00	53.978.483	Lloyds Banking	29.118.610	1,62
Canada				3.303.964	Standard Chartered	30.071.778	1,68
976.265	Nuvei	17.651.666	0,98	6.782.583	Vanquis Banking	8.941.859	0,50
Îles Caïmans				173.881.204			
1.349.482	Inter	5.870.247	0,33	États-Unis			
4.389.024	Inter	19.313.429	1,08	824.185	American International	48.157.130	2,69
2.167.143	Pagseguro Digital*	19.721.001	1,10	97.272	Ameriprise Financial	33.251.460	1,86
798.532	XP*	20.518.280	1,14	519.273	Apollo Global Management*	44.906.729	2,51
		65.422.957	3,65	2.416.055	Bank of America	69.884.391	3,90
France				842.183	Black Knight	63.854.315	3,56
904.772	SCOR	28.270.888	1,58	1.236.602	Citizens Financial	34.822.712	1,94
Allemagne				1.123.779	Equitable	32.893.011	1,83
2.891.390	Commerzbank	32.013.083	1,79	628.214	Fidelity National Information Services	35.374.730	1,98
Inde				16.834	First Citizens BancShares*	22.949.792	1,28
2.110.837	IndusInd Bank	35.139.286	1,96	353.080	Global Payments*	45.003.577	2,51
1.900.000	Shriram Finance	44.255.775	2,47	48.995	Goldman Sachs	16.178.639	0,90
		79.395.061	4,43	970.439	Jackson Financial	36.526.354	2,04
Irlande				692.978	KKR*	43.186.389	2,41
7.233.985	AIB	33.010.696	1,84	973.490	NCR*	29.934.818	1,67
Italie				2.857.399	New York Community Bancorp*	34.860.268	1,95
14.585.076	Intesa Sanpaolo	39.417.605	2,20	1.194.703	Synchrony Financial	38.839.795	2,17
2.748.140	UniCredit	67.845.884	3,79	1.437.376	Wells Fargo	59.895.458	3,34
		107.263.489	5,99	1.073.521	Western Alliance Bancorp	54.051.782	3,02
Japon				744.571.350			
1.888.900	Rakuten Bank*	24.361.652	1,36	1.693.472.830			
Kazakhstan				94,52			
433.689	Kaspi.KZ JSC	45.103.656	2,52	Total des actions ordinaires			
Mexique				1.693.472.830			
2.594.441	Grupo Financiero Banorte	22.951.636	1,28	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
Pologne				1.693.472.830			
1.050.500	Bank Polska Kasa Opieki	27.543.538	1,54	Autres titres négociables			
Portugal				ACTIONS ORDINAIRES			
145.968.317	Banco Comercial Portugues*	40.938.032	2,28	Fédération de Russie			
Espagne				16.260.180			
6.861.006	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	54.682.270	3,05	Sberbank of Russia**			
25.927.399	Banco de Sabadell	30.323.933	1,69	9.596.859			
		85.006.203	4,74	Royaume-Uni			
				Finablr**			
				122			
				0,00			
				1.816			
				0,00			
				1.693.474.646			
				94,52			
				98.134.889			
				5,48			
				1.791.609.535			
				100,00			

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

World Financials Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	5.305	USD	5.819	BNY Mellon	15/9/2023	(60)
USD	411	EUR	376	BNY Mellon	15/9/2023	2
Moins-value nette non réalisée						(58)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	38.652.990	USD	4.951.710	BNY Mellon	15/9/2023	(20.697)
USD	444.421	HKD	3.476.925	BNY Mellon	15/9/2023	866
Moins-value nette non réalisée						(19.831)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	76.425.734	USD	56.765.852	BNY Mellon	15/9/2023	(197.638)
USD	4.825.578	SGD	6.527.469	BNY Mellon	15/9/2023	(5.861)
Moins-value nette non réalisée						(203.499)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 66.747.359)						(223.388)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Banques	53,41
Services financiers diversifiés	12,38
Assurance	8,99
Logiciels	8,06
Services commerciaux	3,49
Fonds privés	2,41
Sociétés d'investissement	2,16
Épargne et prêts	1,95
Ordinateurs	1,67
Autres éléments de l'actif net	5,48
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

World Gold Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				Royaume-Uni			
				10.819.899	Endeavour Mining	223.858.714	5,62
				2.591.620	Fresnillo	18.942.850	0,47
						242.801.564	6,09
COMPARTIMENTS				États-Unis			
Canada				2.368.074	Freeport-McMoRan	95.433.382	2,40
14.554.995	Sprott Physical Silver Trust	122.334.733	3,07	6.353.371	Newmont	253.435.969	6,36
Irlande						348.869.351	8,76
101.876	Invesco Physical Gold ETC	19.106.844	0,48	Total des actions ordinaires et warrants			
Total des Compartiments						3.722.430.846	93,49
		141.441.577	3,55	Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
ACTIONS ORDINAIRES ET WARRANTS						3.863.872.423	97,04
Australie				Autres titres négociables			
87.150.437	Bellevue Gold*	95.403.610	2,40	ACTIONS ORDINAIRES ET WARRANTS			
98.182.160	Challenger Gold	4.769.824	0,12	Canada			
26.432.067	Emerald Resources NL	40.577.754	1,02	13.075.000	Allied Merger**	25.757.750	0,65
8.728.672	Newcrest Mining	147.173.927	3,70	8.208.603	Great Basin Gold**	–	0,00
19.943.856	Northern Star Resources	153.861.310	3,86	1.085.209	Osisko Mining (Wts 28/8/2024)**	8	0,00
173.078.457	Predictive Discovery	24.104.050	0,60			25.757.758	0,65
		465.890.475	11,70	Kazakhstan			
Canada				9.373.110	Polymetal International**	39.274.035	0,99
4.266.643	Agnico Eagle Mines*	208.340.054	5,23	Fédération de Russie			
14.813.752	Alamos Gold	192.171.991	4,83	5.317.500	GV Gold Vysochaishy**	53.175	0,00
7.953.913	Artemis Gold	36.157.954	0,91	1.347.782	Polyus**	140	0,00
58.029.985	B2Gold*	182.301.099	4,58			53.315	0,00
14.819.827	Barrick Gold*	242.600.568	6,09	États-Unis			
18.573.377	Centerra Gold*	111.479.446	2,80	1.625.145	Allied Gold**	–	0,00
10.680.431	Dundee Precious Metals	71.684.048	1,80	Total des actions ordinaires et warrants			
2.529.875	Eldorado Gold	24.109.709	0,61			65.085.108	1,64
1.284.569	Franco-Nevada	185.603.195	4,66	OBLIGATIONS			
29.359.555	Kinross Gold*	150.394.032	3,78	Canada			
10.045.837	Lundin Gold	121.223.611	3,05	CAD 3.207.464	Great Basin Gold 8% 30/11/2014**,**	–	0,00
7.022.980	MAG Silver	80.983.012	2,03	Total des obligations			
24.473.527	Marathon Gold	13.929.489	0,35			–	0,00
8.041.400	Marathon Gold (Wts 20/9/2024)	307.321	0,01	DROITS			
6.327.276	Osisko Gold Royalties	85.354.721	2,14	Canada			
33.980.046	Osisko Mining	71.332.953	1,79	2.090.998	Kinross Gold (31/12/2024)**	16	0,00
6.666.710	Pan American Silver*	109.467.378	2,75	Total Droits			
9.092.516	Rupert Resources	24.800.380	0,62			16	0,00
7.925.731	Skeena Resources	39.779.288	1,00	Total des autres valeurs mobilières			
9.017.405	SSR Mining*	135.621.772	3,41			65.085.124	1,64
7.747.924	Torex Gold Resources	90.516.499	2,27	Total du portefeuille			
4.973.679	Wheaton Precious Metals*	217.607.566	5,47			3.928.957.547	98,69
				Autres éléments de l'actif net			
		2.395.766.086	60,18			52.299.163	1,31
Afrique du Sud				Total de l'actif net (USD)			
3.499.826	AngloGold Ashanti	60.721.981	1,52			3.981.256.710	100,00
5.685.128	Gold Fields*	73.281.300	1,84				
9.952.017	Gold Fields*	128.814.763	3,24				
946.173	Northam Platinum	6.285.326	0,16				
		269.103.370	6,76				

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

*** Ce titre est en défaut, voir point 2(b).

World Gold Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	28.686.739	USD	18.675.932	BNY Mellon	15/9/2023	(86.491)
USD	1.643.125	AUD	2.543.336	BNY Mellon	15/9/2023	(4.990)
Moins-value nette non réalisée						(91.481)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	14.972.197	USD	17.140.562	BNY Mellon	15/9/2023	(168.049)
USD	1.256.698	CHF	1.101.149	BNY Mellon	15/9/2023	8.438
Moins-value nette non réalisée						(159.611)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	251.781.113	USD	276.130.612	BNY Mellon	15/9/2023	(2.814.872)
USD	20.684.248	EUR	18.957.538	BNY Mellon	15/9/2023	105.344
Moins-value nette non réalisée						(2.709.528)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	9.057.892	USD	11.524.257	BNY Mellon	15/9/2023	(41.444)
USD	934.823	GBP	734.938	BNY Mellon	15/9/2023	3.133
Moins-value nette non réalisée						(38.311)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	81.975.815	USD	10.500.668	BNY Mellon	15/9/2023	(42.903)
USD	802.799	HKD	6.278.221	BNY Mellon	15/9/2023	1.878
Moins-value nette non réalisée						(41.025)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	32.933.051	USD	8.102.124	BNY Mellon	15/9/2023	(111.815)
USD	509.401	PLN	2.090.830	BNY Mellon	15/9/2023	2.114
Moins-value nette non réalisée						(109.701)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	97.200.296	USD	72.191.380	BNY Mellon	15/9/2023	(246.409)
USD	5.170.794	SGD	7.004.773	BNY Mellon	15/9/2023	(13.930)
Moins-value nette non réalisée						(260.339)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 441.427.228)						(3.409.996)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Exploitations minières	93,47
Fonds d'investissement	3,55
Investissements et services immobiliers	1,67
Autres éléments de l'actif net	1,31
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

World Healthscience Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				1.486.398	Roche	441.185.718	3,24
				394.893	Sonova*	104.847.663	0,77
						967.102.310	7,10
COMPARTIMENTS				Royaume-Uni			
Irlande				3.484.037	AstraZeneca	474.954.658	3,49
254.772.307	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund ⁻	254.772.307	1,87	198.555	Immunocore*	11.109.152	0,08
Total des Compartiments						486.063.810	3,57
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES				États-Unis			
Belgique				2.530.896	Abbott Laboratories*	264.225.543	1,95
570.073	UCB*	51.186.893	0,38	2.618.243	AbbVie	389.097.092	2,86
Îles Caïmans				437.016	Agilent Technologies	53.718.006	0,39
5.942.000	Abbisko Cayman	1.803.137	0,01	130.298	Align Technology	48.646.759	0,35
3.127.626	Antengene	482.525	0,01	320.713	Alnylam Pharmaceuticals*	63.982.244	0,47
76.940	BeiGene*	16.222.799	0,12	1.290.151	Amgen	331.555.906	2,44
1.000.000	Everest Medicines	2.307.797	0,02	1.721.029	Avantor*	37.948.689	0,28
15.025.500	Kindstar Globalgene Technology	2.912.001	0,02	2.152.630	Baxter International	89.118.882	0,65
	Legend Biotech	22.134.744	0,16	859.023	Becton Dickinson*	241.643.170	1,78
317.344	MoonLake Immunotherapeutics	7.893.564	0,06	744.495	Biogen	198.400.472	1,45
139.413				309.831	BioMarin Pharmaceutical	29.246.497	0,22
		53.756.567	0,40	297.659	Blueprint Medicines*	14.757.933	0,11
Danemark				8.960.129	Boston Scientific	487.968.626	3,59
135.124	Genmab*	52.330.805	0,39	1.499.137	Bristol-Myers Squibb	93.411.226	0,69
405.136	Genmab	15.694.968	0,11	382.850	Catalent*	19.138.672	0,14
4.132.158	Novo Nordisk*	768.746.390	5,65	1.304.158	Cencora	231.788.001	1,70
		836.772.163	6,15	537.955	Centene	33.864.267	0,25
France				508.982	Cigna	143.151.187	1,05
437.910	EssilorLuxottica*	83.562.059	0,61	254.781	Cooper	95.545.423	0,71
3.941.483	Sanofi	425.533.932	3,13	1.080.924	Danaher	288.077.055	2,12
		509.095.991	3,74	665.857	Dexcom	68.589.930	0,51
Allemagne				716.311	Edwards Lifesciences	55.564.244	0,41
192.181	BioNTech*	23.826.600	0,17	389.936	Elevance Health	178.044.778	1,31
90.159	Sartorius*	36.838.099	0,27	1.670.069	Eli Lilly	916.867.881	6,74
		60.664.699	0,44	323.083	Exact Sciences*	26.909.583	0,19
Irlande				881.000	GE HealthCare Technologies*	61.995.970	0,46
147.846	Horizon Therapeutics	16.714.730	0,12	3.195.656	Gilead Sciences	245.554.207	1,80
2.564.867	Medtronic	211.473.284	1,56	405.329	HCA Healthcare	113.443.481	0,84
81.544	Prothena	4.435.178	0,03	269.911	Hologic	20.472.749	0,15
301.438	STERIS	69.924.573	0,51	246.661	Humana	116.362.327	0,85
		302.547.765	2,22	146.309	IDEXX Laboratories*	74.911.671	0,55
Japon				114.688	illumina*	19.178.127	0,14
2.791.000	Daiichi Sankyo	82.094.430	0,60	440.247	Incyte	28.519.201	0,20
497.000	Eisai*	31.481.830	0,23	1.241.052	Intuitive Surgical	397.335.209	2,92
		113.576.260	0,83	510.007	IQVIA*	115.266.682	0,85
Jersey				1.953.222	Johnson & Johnson	315.894.594	2,32
530.011	Novocure*	11.538.340	0,08	293.851	Masimo*	33.729.687	0,25
Pays-Bas				732.722	McKesson	307.083.790	2,25
217.384	Argenx*	109.555.014	0,80	5.046.239	Merck	554.632.128	4,07
1.204.827	QIAGEN	55.373.849	0,41	36.259	Mettler-Toledo International	44.403.497	0,33
		164.928.863	1,21	221.178	Mirati Therapeutics*	8.228.927	0,06
Suisse				647.128	Moderna*	74.322.650	0,54
2.314.077	Alcon*	194.409.813	1,43	150.463	Neurocrine Biosciences	16.383.916	0,12
156.817	Lonza	87.285.376	0,64	134.275	Penumbra*	35.247.187	0,26
1.373.841	Novartis*	139.373.740	1,02	6.821.733	Pfizer	244.900.214	1,79
				514.030	Quest Diagnostics*	69.157.596	0,51
				3.326	Reata Pharmaceuticals	561.961	0,00
				182.450	Regeneron Pharmaceuticals†	151.557.566	1,11
				140.475	Repligen*	24.281.104	0,18
				226.570	REVOLUTION Medicines	7.565.172	0,06
				660.367	Rhythm Pharmaceuticals*	17.248.786	0,12
				179.232	Sarepta Therapeutics*	21.561.610	0,16
				417.303	Seagen	86.452.662	0,63
				1.005.459	Stryker	290.622.897	2,13

⁻ Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

[†] Tout ou partie de ce titre est mis en gage ou donné en garantie, voir note 13, pour plus de détails.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

World Healthscience Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
885.494	Thermo Fisher Scientific	497.603.354	3,66	Autres titres négociables			
1.663.333	UnitedHealth	815.033.170	5,99	ACTIONS ORDINAIRES			
797.922	Vertex Pharmaceuticals	277.325.771	2,04	États-Unis			
101.875	Waters*	29.326.756	0,22	264.817	Contra Abiomed**	738.839	0,01
368.281	West Pharmaceutical Services	150.881.043	1,11	Total des actions ordinaires			
664.486	Zoetis*	128.252.443	0,95	Total des autres valeurs mobilières			
		9.796.560.171	71,98	Total du portefeuille			
Total des actions ordinaires et privilégiées			98,10	Autres éléments de l'actif net			
Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			99,97	Total de l'actif net (USD)			
						13.609.304.978	99,98
						2.500.596	0,02
						13.611.805.574	100,00

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	134.942.000	USD	90.039.807	State Street	14/9/2023	(2.598.729)
EUR	181.380.000	USD	195.081.445	RBS	14/9/2023	1.801.222
JPY	18.060.000.000	USD	130.843.017	Goldman Sachs	14/9/2023	(7.077.482)
JPY	53.985.234.700	USD	390.695.960	State Street	14/9/2023	(20.734.082)
Moins-value nette non réalisée						(28.609.071)
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	85.318.309	USD	55.542.257	BNY Mellon	15/9/2023	(254.704)
USD	3.442.093	AUD	5.325.580	BNY Mellon	15/9/2023	(8.951)
Moins-value nette non réalisée						(263.655)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	556.080.544	USD	77.044.875	BNY Mellon	15/9/2023	(567.559)
USD	3.713.450	CNY	27.032.370	BNY Mellon	15/9/2023	(4.272)
Moins-value nette non réalisée						(571.831)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	220.045.078	USD	241.347.914	BNY Mellon	15/9/2023	(2.482.553)
USD	18.864.974	EUR	17.300.137	BNY Mellon	15/9/2023	85.227
Moins-value nette non réalisée						(2.397.326)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	214.419.105	USD	27.470.491	BNY Mellon	15/9/2023	(116.759)
USD	1.338.004	HKD	10.470.451	BNY Mellon	15/9/2023	2.275
Moins-value nette non réalisée						(114.484)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	198.447.886	USD	1.392.271	BNY Mellon	15/9/2023	(32.029)
USD	43.024	JPY	6.250.544	BNY Mellon	15/9/2023	182
Moins-value nette non réalisée						(31.847)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
SGD	192.117.783	USD	142.707.374	BNY Mellon	15/9/2023	(507.096)
USD	5.536.575	SGD	7.500.920	BNY Mellon	15/9/2023	(15.382)
Moins-value nette non réalisée						(522.478)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 1.351.097.683)						(32.510.692)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

World Healthscience Fund suite

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Produits pharmaceutiques	44,70
Produits de santé	27,52
Biotechnologie	13,50
Services de santé	11,40
Fonds d'investissement	1,87
Électronique	0,99
Autres éléments de l'actif net	0,02
	100,00

World Mining Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé							
ACTIONS ORDINAIRES ET PRIVILÉGIÉES							
Australie				Suède			
16.091.107	BHP	467.473.401	8,64	1.719.211	Epiroc	33.188.910	0,61
9.766.787	Chalice Mining*	22.585.435	0,42	Royaume-Uni			
14.188.486	Champion Iron*	55.970.848	1,03	4.209.465	Anglo American	113.179.282	2,09
6.666.987	Deterra Royalties	19.217.556	0,36	1.626.670	Antofagasta*	29.858.458	0,55
6.996.397	Equatorial Resources	725.109	0,01	2.198.015	Endeavour Mining	45.475.915	0,84
10.439.351	Iluka Resources*	57.680.772	1,07	3.649.713	Rio Tinto	226.516.313	4,19
10.469.912	Lynas Rare Earths*	48.761.882	0,90	415.029.968 7,67			
1.673.258	Mineral Resources*	77.528.195	1,43	États-Unis			
6.753.645	Newcrest Mining	113.873.044	2,11	420.529	Albemarle*	83.622.192	1,55
114.861.946	Nickel Industries*	59.149.603	1,09	1.165.510	Alcoa*	35.140.126	0,65
17.353.301	Northern Star Resources	133.875.898	2,47	6.959.171	Freeport-McMoRan	280.454.591	5,18
43.578	Woodside Energy	1.044.990	0,02	416.666	Ivanhoe Electric	6.566.656	0,12
1.057.886.733 19,55				3.875.542	Ivanhoe Electric / US*	61.078.542	1,13
				4.159.886	Newmont*	165.937.853	3,07
				1.047.167	Nucor	179.536.782	3,32
				890.383	Steel Dynamics	94.870.309	1,75
				907.207.051 16,77			
				Total des actions ordinaires et privilégiées 5.098.455.333 94,25			
Brésil				OBLIGATIONS			
3.336.948	Bradespar	15.408.593	0,29	Brésil			
23.547.702	Vale	315.892.422	5,84	BRL 6.750	Vale 0% 30/3/2172	39.868	0,00
331.301.015 6,13				Total des obligations 39.868 0,00			
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé 5.098.495.201 94,25			
Canada				Autres titres négociables			
239.179	Agnico Eagle Mines	11.679.104	0,22	ACTIONS ORDINAIRES			
8.745.766	Barrick Gold*	143.168.190	2,65	Canada			
2.738.377	Cameco*	101.895.008	1,88	1.071.864	Filo Mining 4 Month Hold**	16.558.991	0,30
2.054.757	ERO Copper*	42.390.467	0,78	Kazakhstan			
8.115.624	First Quantum Minerals*	214.459.783	3,96	4.355.902	Polymetal International**	18.251.556	0,34
5.085.383	Foran Mining	14.321.765	0,27	Fédération de Russie			
1.027.784	Franco-Nevada	148.501.166	2,75	1	Polyus**	-	0,00
16.763.886	Ivanhoe Mines	150.866.066	2,79	376.830	Polyus**	39	0,00
9.875.717	Lundin Mining*	75.991.893	1,40	39 0,00			
3.405.252	Sigma Lithium	102.193.480	1,89	États-Unis			
10.025.254	Solaris Resources	43.869.733	0,81	3.470.000	CSA Cobar Pipe**	38.753.307	0,72
1.963.707	Stelco*	56.667.545	1,05	243.000	Metal Founders**	2.230.740	0,04
4.811.481	Teck Resources*	201.299.689	3,72	40.984.047 0,76			
4.107.298	Wheaton Precious Metals*	179.701.810	3,32	Total des actions ordinaires 75.794.633 1,40			
1.487.005.699 27,49				Total des autres valeurs mobilières 75.794.633 1,40			
				Total du portefeuille 5.174.289.834 95,65			
Chili				Autres éléments de l'actif net 235.391.762 4,35			
641.886	Sociedad Quimica y Minera de Chile*	39.938.147	0,74	Total de l'actif net (USD) 5.409.681.596 100,00			
Allemagne							
329.381	Aurubis*	27.309.477	0,50				
Jersey							
69.606.538	Glencore	371.608.980	6,87				
Luxembourg							
6.550.689	ArcelorMittal*	175.190.970	3,24				
Norvège							
20.753.129	Norsk Hydro	115.801.021	2,14				
Pérou							
3.292.350	Sociedad Minera Cerro Verde	102.062.850	1,89				
Afrique du Sud							
1.909.819	Impala Platinum	9.889.587	0,18				
3.165.199	Northam Platinum	21.026.079	0,39				
2.607.346	Sibanye Stillwater*	4.008.846	0,08				
34.924.512 0,65							

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

World Mining Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	38.276.286	USD	24.904.377	BNY Mellon	15/9/2023	(100.769)
USD	3.349.319	AUD	5.184.092	BNY Mellon	15/9/2023	(10.042)
Moins-value nette non réalisée						(110.811)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	14.084.067	USD	16.117.623	BNY Mellon	15/9/2023	(151.900)
USD	1.770.333	CHF	1.551.411	BNY Mellon	15/9/2023	11.654
Moins-value nette non réalisée						(140.246)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	173.375.833	USD	190.172.543	BNY Mellon	15/9/2023	(1.968.004)
USD	20.879.141	EUR	19.126.966	BNY Mellon	15/9/2023	116.312
Moins-value nette non réalisée						(1.851.692)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	10.539.472	USD	13.406.114	BNY Mellon	15/9/2023	(45.082)
USD	1.263.133	GBP	994.527	BNY Mellon	15/9/2023	2.358
Moins-value nette non réalisée						(42.724)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	13.604.903	USD	1.742.760	BNY Mellon	15/9/2023	(7.166)
USD	190.751	HKD	1.491.683	BNY Mellon	15/9/2023	457
Moins-value nette non réalisée						(6.709)
Catégorie d'Actions couverte en PLN						
PLN	49.533.831	USD	12.188.518	BNY Mellon	15/9/2023	(170.483)
USD	1.303.154	PLN	5.336.532	BNY Mellon	15/9/2023	8.384
Moins-value nette non réalisée						(162.099)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	6	SGD	8	BNY Mellon	5/9/2023	-
SGD	61.128.587	USD	45.405.515	BNY Mellon	15/9/2023	(159.823)
USD	4.921.522	SGD	6.659.571	BNY Mellon	15/9/2023	(7.697)
Moins-value nette non réalisée						(167.520)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 334.727.488)						(2.481.801)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Exploitations minières	70,89
Fer/Acier	17,71
Charbon	3,72
Produits chimiques	2,29
Machines-construction et exploitation minière	0,61
Sociétés d'investissement	0,29
Commerces de détail	0,12
Producteurs de pétrole et de gaz	0,02
Autres éléments de l'actif net	4,35
	100,00

World Real Estate Securities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
AUD	447.000	USD	295.831	Morgan Stanley	16/10/2023	(5.835)
AUD	3.698.000	USD	2.492.569	Deutsche Bank	16/10/2023	(93.455)
AUD	352.000	USD	230.708	BNY Mellon	16/10/2023	(2.345)
CAD	954.000	USD	722.940	Citigroup	16/10/2023	(17.331)
CAD	2.101.000	USD	1.596.394	Morgan Stanley	16/10/2023	(42.426)
CAD	1.000	USD	735	Deutsche Bank	16/10/2023	5
CHF	725.000	USD	839.935	Morgan Stanley	16/10/2023	(15.277)
CHF	67.000	USD	77.687	Citigroup	16/10/2023	(1.477)
EUR	3.338.000	USD	3.693.262	Morgan Stanley	16/10/2023	(64.236)
EUR	367.000	USD	403.948	Citigroup	16/10/2023	(4.951)
GBP	2.272.000	USD	2.916.837	Morgan Stanley	16/10/2023	(36.320)
GBP	34.000	USD	43.172	Citigroup	16/10/2023	(65)
GBP	54.000	USD	67.975	Deutsche Bank	16/10/2023	488
HKD	21.099.000	USD	2.707.257	Morgan Stanley	16/10/2023	(11.791)
HKD	1.191.000	USD	152.411	BNY Mellon	16/10/2023	(257)
HKD	1.781.000	USD	228.640	Bank of America	16/10/2023	(1.111)
ILS	1.494.000	USD	410.346	Deutsche Bank	16/10/2023	(17.810)
JPY	215.874.363	USD	1.519.822	BNY Mellon	16/10/2023	(32.674)
JPY	856.447.000	USD	6.091.758	Deutsche Bank	16/10/2023	(191.732)
JPY	72.437.000	USD	508.291	Morgan Stanley	16/10/2023	(9.274)
JPY	43.541.000	USD	301.627	Nomura	16/10/2023	(1.675)
NOK	632.000	USD	62.718	Morgan Stanley	16/10/2023	(3.293)
NZD	677.000	USD	426.695	Nomura	16/10/2023	(24.016)
NZD	418.000	USD	259.900	BNY Mellon	16/10/2023	(11.273)
SEK	2.038.000	USD	197.201	Deutsche Bank	16/10/2023	(10.006)
SEK	12.868.000	USD	1.230.056	Morgan Stanley	16/10/2023	(48.103)
SEK	251.000	USD	24.386	Bank of America	16/10/2023	(1.331)
SGD	5.265.000	USD	3.974.159	Bank of America	16/10/2023	(71.580)
SGD	24.000	USD	18.201	Citibank	16/10/2023	(411)
SGD	3.012.000	USD	2.275.146	BNY Mellon	16/10/2023	(42.560)
USD	425.484	KRW	550.680.000	Morgan Stanley	16/10/2023	8.429
USD	1.294.781	GBP	1.006.000	Morgan Stanley	16/10/2023	19.341
USD	613.241	EUR	556.000	Morgan Stanley	16/10/2023	8.766
USD	1.861.156	HKD	14.540.000	Morgan Stanley	16/10/2023	3.623
USD	740.157	EUR	662.000	Nomura	16/10/2023	20.440
USD	2.979.306	GBP	2.340.000	Deutsche Bank	16/10/2023	12.577
USD	2.452.617	AUD	3.727.000	Morgan Stanley	16/10/2023	34.688
USD	15.696	GBP	12.000	Citigroup	16/10/2023	482
USD	254.238	JPY	35.390.000	BNY Mellon	16/10/2023	10.438
USD	3.802.949	EUR	3.454.000	Deutsche Bank	16/10/2023	47.810
USD	4.157.797	HKD	32.429.000	BNY Mellon	16/10/2023	14.885
USD	64.447	AUD	95.000	BNY Mellon	16/10/2023	2.815
USD	470.013	GBP	364.000	Citibank	16/10/2023	8.522
USD	199.950	AUD	304.000	Deutsche Bank	16/10/2023	2.727
USD	36.481	CAD	48.000	Deutsche Bank	16/10/2023	979
USD	1.543.091	JPY	217.962.000	Deutsche Bank	16/10/2023	41.561
USD	497.143	SGD	664.000	BNY Mellon	16/10/2023	4.966
USD	1.009.254	SEK	10.761.000	Morgan Stanley	16/10/2023	20.830
USD	1.673.375	CAD	2.229.000	Citigroup	16/10/2023	24.735
USD	5.704.911	JPY	806.975.000	Morgan Stanley	16/10/2023	145.695
USD	48.023	SEK	514.000	Citigroup	16/10/2023	811
USD	30.634	SGD	41.000	Citigroup	16/10/2023	243
USD	237.444	HKD	1.852.000	Citigroup	16/10/2023	845
USD	685.163	CHF	596.000	Deutsche Bank	16/10/2023	7.237
USD	30.888	EUR	28.000	Citigroup	16/10/2023	447
USD	32.239	CHF	28.000	Morgan Stanley	16/10/2023	390
Moins-value nette non réalisée						(317.840)

World Real Estate Securities Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	2.093.516	USD	1.363.009	BNY Mellon	15/9/2023	(6.378)
USD	94.231	AUD	145.715	BNY Mellon	15/9/2023	(196)
Moins-value nette non réalisée						(6.574)
Catégorie d'Actions couverte en CHF						
CHF	535.898	USD	613.472	BNY Mellon	15/9/2023	(5.976)
USD	38.024	CHF	33.364	BNY Mellon	15/9/2023	202
Moins-value nette non réalisée						(5.774)
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	2.921.846	USD	404.571	BNY Mellon	15/9/2023	(2.730)
USD	24.147	CNY	175.693	BNY Mellon	15/9/2023	(18)
Moins-value nette non réalisée						(2.748)
Catégorie d'Actions couverte en HKD						
HKD	70.382	USD	9.016	BNY Mellon	15/9/2023	(37)
USD	2.959	HKD	23.150	BNY Mellon	15/9/2023	5
Moins-value nette non réalisée						(32)
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	57	SGD	77	BNY Mellon	5/9/2023	-
SGD	382.436	USD	284.053	BNY Mellon	15/9/2023	(987)
USD	18.698	SGD	25.320	BNY Mellon	15/9/2023	(41)
Moins-value nette non réalisée						(1.028)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 66.076.576)						(333.996)

« Contracts for difference » au 31 août 2023

Nombre	Description	Contrepartie	Plus-value non réalisée USD
États-Unis			
2.387	Agree Realty	Morgan Stanley	453
1.683	Equinix	Morgan Stanley	61.127
18.792	SL Green Realty	Morgan Stanley	110.685
			172.265
Total (USD Exposition sous-jacente - USD 2.203.745)			172.265

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Sociétés de placement immobilier	83,69
Investissements et services immobiliers	12,54
Fonds privés	1,15
Ingénierie et construction	0,90
Télécommunications	0,54
Autres éléments de l'actif net	1,18
<hr/>	
	100,00

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

World Technology Fund

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net	Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé				États-Unis			
DROITS				167.318	Adobe	93.316.595	0,95
Canada				2.031.995	Advanced Micro Devices	218.236.263	2,23
45.403	Constellation Software (2/10/2023)	16.613	0,00	1.750.108	Alphabet	239.309.768	2,44
Total Droits				1.593.276	Amazon.com	219.489.702	2,24
COMPARTIMENTS				327.097	ANSYS*	103.853.298	1,06
Irlande				4.609.741	Apple	866.907.892	8,85
119.217.197	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund [~]	119.217.197	1,22	322.321	Applied Materials	48.976.676	0,50
Total des Compartiments				371.584	Arista Networks*	71.329.264	0,73
ACTIONS ORDINAIRES				269.170	Aspen Technology*	52.770.779	0,54
Australie				271.013	Autodesk	60.262.451	0,62
2.210.845	Altium*	69.326.921	0,71	289.511	Broadcom	263.967.444	2,69
Canada				1.343.874	Cadence Design Systems	324.491.816	3,31
45.403	Constellation Software	92.385.530	0,94	3.061.529	Coupang*	57.709.822	0,59
878.578	Shopify*	57.010.926	0,58	397.788	Crowdstrike*	63.944.421	0,65
464.101	Thomson Reuters*	59.804.317	0,61	215.362	Equifax*	44.926.667	0,46
				155.600	Fair Isaac	141.536.872	1,44
				209.200.773	First Solar	53.882.237	0,55
Îles Caïmans				331.370	Intuit*	179.281.111	1,83
1.726.850	Trip.com	68.123.033	0,70	245.330	Lam Research	170.521.523	1,74
France				2.373.649	Marvell Technology	138.834.730	1,42
710.649	SOITEC*	130.687.083	1,33	633.142	Mastercard	262.424.696	2,68
Allemagne				102.717	MercadoLibre*	138.873.384	1,42
325.683	SAP*	45.928.201	0,47	830.656	Meta Platforms	248.083.721	2,53
Japon				1.295.574	Micron Technology	91.027.029	0,93
830.400	GMO Payment Gateway*	52.430.178	0,54	2.714.480	Microsoft	893.226.789	9,12
81.400	Keyence*	33.706.195	0,34	317.085	MongoDB*	121.357.942	1,24
2.364.600	Renesas Electronics	39.645.947	0,40	294.832	Monolithic Power Systems	153.595.679	1,57
622.500	Sony	51.727.714	0,53	215.530	Motorola Solutions	61.238.539	0,63
				151.256	Netflix	65.871.988	0,67
				1.454.880	NEXTracker*	61.134.058	0,62
				1.702.311	NVIDIA	846.372.006	8,64
				1.768.211	Oracle	213.776.710	2,18
				263.144	Palo Alto Networks	63.601.905	0,65
				1.198.507	Rocket Lab USA*	7.730.370	0,08
				210.508	S&P Global*	82.784.376	0,84
				516.186	Salesforce	116.988.395	1,19
				157.711	ServiceNow	93.472.155	0,95
				193.926	Snowflake*	30.516.195	0,31
				356.665	Take-Two Interactive Software	50.824.763	0,52
				1.098.621	Tesla	282.598.280	2,88
				1.817.736	Uber Technologies	85.033.690	0,87
				887.340	Visa*	219.146.360	2,24
				2.192.831	Warner Music*	73.437.910	0,75
				2.037.057	Wolfspeed*	97.004.654	0,99
						7.773.670.925	79,34
				Total des actions ordinaires		9.513.365.080	97,09
				Total des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse ou négociés sur un autre marché réglementé			
						9.632.598.890	98,31
				Autres titres négociables			
				ACTIONS ORDINAIRES ET WARRANTS			
				Canada			
				45.403	Constellation Software (Wts 31/3/2040)**	3	0,00
				Inde			
				2.985	Think & Learn Pvt**	2.255.233	0,02
				2.822	Think & Learn Pvt**	2.132.083	0,02
						4.387.316	0,04
				Suède			
				43.738	Klarna Bank**	9.252.493	0,10
						102.452.368	1,05

[~] Investissement dans le fonds d'une partie liée, pour plus d'informations voir le point 10 de l'Annexe aux états financiers.

* Tout ou partie de ce titre représente un titre en prêt.

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

World Technology Fund suite

Portefeuille de titres au 31 août 2023

Nombre	Description	Valeur de marché (USD)	% de l'actif net
États-Unis			
325.875	ByteDance**	56.601.172	0,58
258.450	Databricks**	13.803.815	0,14
469.125	Databricks**	25.055.966	0,25
439.764	Databricks**	23.487.795	0,24
230.500	Farmer's Business Network**	5.619.590	0,06
193.800	SambaNova Systems**	15.381.906	0,16
396.000	Unqork**	3.215.520	0,03
11.920	Unqork**	70.447	0,00
19.160	Unqork**	124.732	0,00
10.880	Unqork**	61.472	0,00
249.240	Unqork**	1.395.744	0,02
29.880	Unqork**	169.419	0,00
		144.987.578	1,48
Total des actions ordinaires et warrants		158.627.390	1,62
Total des autres valeurs mobilières		158.627.390	1,62
Total du portefeuille		9.791.226.280	99,92
Autres éléments de l'actif net		7.562.372	0,08
Total de l'actif net (USD)		9.798.788.652	100,00

** Titre faisant l'objet d'un ajustement à la juste valeur, comme indiqué au point 2(j) de l'Annexe aux états financiers.

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en AUD						
AUD	49.905.906	USD	32.446.321	BNY Mellon	15/9/2023	(106.557)
USD	2.679.315	AUD	4.154.732	BNY Mellon	15/9/2023	(13.003)
Moins-value nette non réalisée						(119.560)
Catégorie d'Actions couverte en BRL						
BRL	2.059.927	USD	414.981	BNY Mellon	15/9/2023	2.378
USD	43.910	BRL	216.541	BNY Mellon	15/9/2023	37
Plus-value nette non réalisée						2.415
Catégorie d'Actions couverte en CNH						
CNY	487.533.727	USD	67.471.556	BNY Mellon	15/9/2023	(421.474)
USD	5.536.672	CNY	40.239.061	BNY Mellon	15/9/2023	2.650
Moins-value nette non réalisée						(418.824)
Catégorie d'Actions couverte en EUR						
EUR	152.976.018	USD	167.760.897	BNY Mellon	15/9/2023	(1.700.973)
USD	14.341.825	EUR	13.156.485	BNY Mellon	15/9/2023	60.121
Moins-value nette non réalisée						(1.640.852)
Catégorie d'Actions couverte en GBP						
GBP	1.268.687	USD	1.614.128	BNY Mellon	15/9/2023	(5.796)
USD	137.944	GBP	108.728	BNY Mellon	15/9/2023	108
Moins-value nette non réalisée						(5.688)
Catégorie d'Actions couverte en JPY						
JPY	193.997.360	USD	1.359.842	BNY Mellon	15/9/2023	(30.108)
USD	120.470	JPY	17.426.199	BNY Mellon	15/9/2023	1.028
Moins-value nette non réalisée						(29.080)

L'Annexe des pages 984 à 999 fait partie intégrante de ces états financiers.

World Technology Fund suite

Contrats de change à terme ouverts au 31 août 2023

Devise	Achats	Devise	Ventes	Contrepartie	Date d'échéance	Plus-values/ (moins-values) non réalisées USD
Catégorie d'Actions couverte en SGD						
USD	9.158	SGD	12.398	BNY Mellon	5/9/2023	(15)
SGD	345.744.066	USD	256.763.129	BNY Mellon	15/9/2023	(852.949)
USD	20.565.645	SGD	27.834.131	BNY Mellon	15/9/2023	(36.355)
Moins-value nette non réalisée						(889.319)
Total des moins-values nettes non réalisées (USD Exposition sous-jacente - USD 567.698.836)						(3.100.908)

Répartition sectorielle au 31 août 2023

	% de l'actif net
Semi-conducteurs	28,92
Logiciels	28,03
Internet	13,39
Ordinateurs	10,16
Services financiers diversifiés	4,91
Services commerciaux	3,14
Constructeurs automobiles	2,88
Électronique	1,43
Télécommunications	1,36
Logiciels d'application	1,26
Fonds d'investissement	1,22
Divertissement	0,75
Média	0,61
Sources d'énergie alternatives	0,55
Mobilier d'intérieur	0,53
Diversification des machines	0,34
Systèmes logiciels	0,16
Traitement de données et services externalisés	0,10
Aérospatiale/Défense	0,08
Transporteurs alternatifs	0,06
Services éducatifs	0,04
Autres éléments de l'actif net	0,08
	100,00

Annexe aux États Financiers

1. Organisation

La Société est une société anonyme constituée, conformément aux lois du Grand-Duché de Luxembourg, en tant que société d'investissement à capital variable. La Société a été autorisée par la Commission de surveillance du secteur financier (la « CSSF ») comme organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») conformément aux dispositions de la Partie I de la loi du 17 décembre 2010, telle qu'amendée le cas échéant, et est réglementée par cette loi.

La Société est un fonds à compartiments multiples, à responsabilité séparée entre ses compartiments. Le passif de chaque compartiment est distinct de celui des autres compartiments, et la Société dans son ensemble n'est pas responsable, vis-à-vis de tierces parties, des passifs de chaque compartiment. Chaque compartiment sera constitué d'un portefeuille d'investissements séparé, tenu et investi conformément aux objectifs d'investissement applicables à ce Compartiment.

Au 31 août 2023, la Société offrait les actions de 103 compartiments (dénommés individuellement « Compartiment » et collectivement « Compartiments »). Chaque Compartiment est un pool distinct d'actifs et est représenté par des actions distinctes, elles-mêmes divisées en catégories d'actions, comme indiqué à l'Annexe I.

Ces Catégories d'Actions ont des droits équivalents dans la Société, mais présentent des caractéristiques et des frais de vente différents, qui sont détaillés dans le Prospectus de la Société.

Événements importants au cours de l'exercice

Au 31 août 2023, le Compartiment Swiss Small & MidCap Opportunities Fund reste fermé aux souscriptions de nouveaux actionnaires et d'actionnaires existants. Les actionnaires peuvent procéder à des rachats comme d'habitude, conformément au Prospectus de la Société.

Avec effet le 6 septembre 2022, le Compartiment China Onshore Bond Fund, libellé en CNH, a été lancé.

Avec effet le 13 septembre 2022, un addendum au Prospectus a été publié.

Avec effet le 22 septembre 2022, le Compartiment Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund, libellé en USD, a été lancé.

Avec effet le 4 octobre 2022, le Compartiment Sustainable Global Allocation Fund, libellé en USD, a été lancé.

Avec effet le 6 octobre 2022, le Compartiment Impact Bond Fund, libellé en EUR, a été lancé.

Avec effet le 6 octobre 2022, Bettina Mazzocchi a été nommée au Conseil d'administration de la Société.

Avec effet le 15 décembre 2022, une mise à jour du Prospectus de la Société a été publiée.

À compter du 15 décembre 2022, le Compartiment Systematic Global SmallCap Fund a changé de nom pour devenir le Systematic Sustainable Global SmallCap Fund, le Compartiment Systematic Multi Allocation Credit Fund a changé de nom pour devenir le ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund et le Compartiment World Bond Fund a changé de nom pour devenir le Sustainable World Bond Fund.

Avec effet le 29 décembre 2022, une mise à jour du Prospectus de la Société a été publiée.

Avec effet le 2 mars 2023, le Compartiment Asia Pacific Equity Income Fund a été dissous.

Avec effet le 3 mars 2023, Vasiliki Pachatouridi a été nommée au Conseil d'administration de la Société.

Avec effet le 23 mai 2023, un addendum au Prospectus a été publié.

Avec effet le 6 juin 2023, le Compartiment Brown To Green Materials Fund, libellé en USD, a été lancé.

Avec effet le 15 juin 2023, le Compartiment Systematic China Environmental Tech Fund, libellé en USD, a été lancé.

Avec effet le 13 juillet 2023, le Compartiment China Multi-Asset Fund, libellé en USD, a été lancé.

Le Conseil d'administration et le Gestionnaire Financier par délégation continuent de surveiller la performance des investissements conformément aux objectifs d'investissement des Compartiments compte tenu des tensions géopolitiques découlant de l'incursion russe en Ukraine. Les opérations des Compartiments et la publication des valeurs liquidatives se poursuivent, à l'exception du BGF Emerging Europe Fund (pour le reste du présent paragraphe, le « Compartiment »). En raison de l'exposition importante du Compartiment aux investissements en Russie, les conditions de négociation du Compartiment ont été significativement impactées. Par conséquent, le Conseil d'administration a considéré qu'il était dans l'intérêt du Compartiment et de ses investisseurs que les souscriptions, les rachats et les conversions de toutes les catégories d'actions du Compartiment et la détermination des valeurs liquidatives soient temporairement suspendus à compter du 1er mars 2022 jusqu'à nouvel ordre, à la discrétion du Compartiment, en vertu du prospectus. Le 3 mars 2022, le Conseil d'administration a pris la décision de réduire encore davantage la valeur des titres russes détenus par le Compartiment. Le 9 mars 2022, le Conseil d'administration de la Société de Gestion a pris la décision exceptionnelle supplémentaire de renoncer à ses commissions de gestion et à la Commission de service annuelle liée au Compartiment (avec effet le 1er mars 2022), tandis que l'évaluation, les souscriptions et les rachats dans le Compartiment sont suspendus jusqu'à nouvel ordre via le site Internet de BlackRock. Depuis janvier 2023, les valeurs liquidatives indicatives de fin de mois sont publiées sur le site Internet de BlackRock. La Valeur Liquidative indiquée dans le rapport annuel est la Valeur Liquidative indicative du Compartiment au 31 août 2023. Au 31 août 2023,

Annexe aux États Financiers suite

le Conseil d'administration n'a pas l'intention de fermer le Compartiment et les présents états financiers sont donc préparés sur une base de continuité des activités.

2. Récapitulatif des principales règles comptables

Les états financiers de la Société ont été préparés sur une base de continuité des activités, à l'exception du rapport des Compartiments Asia Pacific Equity Income Fund et China Flexible Equity Fund, qui ont été préparés sur une base de non-continuité des activités suite à la décision des administrateurs de fermer les Compartiments, comme indiqué aux points 1 et 19. Pour ces derniers Compartiments, les principales politiques comptables exposées ci-dessous ont été appliquées de manière cohérente, à l'exception du fait que les valeurs comptables des actifs restants au 31 août 2023 sont présentées à leur valeur de réalisation nette estimée et que tous les passifs sont présentés à leurs montants de règlement estimés. Les états financiers ont été préparés conformément aux exigences légales et réglementaires en matière de préparation des états financiers, telles que prescrites par les autorités luxembourgeoises qui supervisent les sociétés d'investissement au Luxembourg, et intègrent les principales règles comptables suivantes :

(a) Valorisation des investissements et autres actifs

Les titres de placement de la Société sont valorisés comme suit :

- ▶ les titres négociables cotés en bourse ou négociés sur un autre marché réglementé sont évalués sur la base du dernier cours disponible en vigueur à la date d'évaluation. Pour les titres négociés sur des marchés clôturant après la valorisation, les derniers cours connus à ce moment ou à un autre moment seront utilisés. Si ces titres ou autres actifs sont cotés ou négociés sur plusieurs bourses ou marchés réglementés, le Conseil d'administration peut, à sa discrétion, choisir à cet effet l'une de ces bourses ou l'un de ces marchés réglementés. Des écarts dans la valeur des titres peuvent être constatés, par exemple lorsque les marchés sous-jacents sont fermés au public au moment du calcul de la valeur liquidative de certains compartiments ou lorsque les gouvernements décident d'imposer des charges fiscales ou des frais de négociation sur les investissements étrangers. Par conséquent, les Administrateurs ont mis en œuvre des techniques de juste valeur afin d'estimer la juste valeur de ces investissements. De tels titres et instruments dérivés seront évalués à leur valeur de réalisation probable telle que déterminée par des personnes compétentes (les Administrateurs). En raison de l'incertitude inhérente au processus de juste valeur, ces valeurs estimées peuvent différer significativement des valeurs qui auraient été utilisées si un marché facile existait pour ces titres et des valeurs qui pourraient en fin de compte être recouvrées. Le Conseil d'administration de la Société délègue l'évaluation des investissements à la haute direction de la Société de gestion ;
- ▶ pour les titres non cotés ou les titres non négociés sur une bourse ou sur un autre marché réglementé (y compris les titres de fonds d'investissement fermés) ainsi que pour les titres cotés ou non cotés sur d'autres marchés pour lesquels aucun cours n'est disponible, ou les titres pour lesquels les cours ne sont pas, selon les Administrateurs,

représentatifs de la juste valeur de marché, la valeur desdits titres sera déterminée avec prudence et de bonne foi par les Administrateurs, sur la base des prix de cession ou d'acquisition attendus ;

- ▶ les titres à revenu fixe qui ne sont pas cotés sur les places boursières ni négociés sur d'autres marchés réglementés sont valorisés selon le dernier prix médian disponible ou les équivalents en matière de rendement, obtenus auprès d'un ou de plusieurs agents boursiers ou services de fixation des prix. Les titres négociés sur le marché de gré à gré sont valorisés au dernier prix d'achat disponible. Si les titres sont négociés sur plus d'une place boursière, ceux-ci sont valorisés sur la place boursière désignée par ou sous la direction du Conseil d'administration de la Société de Gestion comme marché primaire. Les titres des portefeuilles qui sont négociés aussi bien sur le marché de gré à gré que sur une place boursière sont valorisés selon le marché le plus grand et le plus représentatif ;
- ▶ prêts de titres : les titres sont livrés à un courtier tiers, conformément aux instructions de l'agent de prêt, et continuent à être évalués comme faisant partie intégrante du portefeuille ;
- ▶ les instruments du marché monétaire sont évalués à leurs valeurs nominales plus tout intérêt cumulé ou sur la base du coût amorti qui se rapproche de leur juste valeur de marché ;
- ▶ les instruments du marché monétaire détenus dans les Compartiments Euro Reserve Fund et US Dollar Reserve Fund sont valorisés sur la base de la valeur de marché. En cas d'impossibilité, les actifs sont valorisés avec prudence en utilisant la méthode de comptabilisation par rapport à un modèle mark-to-model ;
- ▶ les dépôts à terme sont valorisés au coût amorti qui se rapproche de leur juste valeur de marché ;
- ▶ les espèces, les dépôts, les effets et billets payables à vue et autres dettes, et les charges payées d'avance sont évalués pour leur valeur nominale, à moins qu'il ne s'avère improbable que cette valeur nominale puisse être recouvrée ;
- ▶ les actifs comprenant notamment des créances recouvrables sur des intérêts et des dividendes, des créances recouvrables pour investissements vendus ainsi que des créances recouvrables pour des actions de compartiment souscrites, sont évalués à leur valeur nominale, à moins qu'il ne s'avère improbable que cette valeur nominale puisse être recouvrée ;
- ▶ les dettes comprenant, en particulier, les dépenses payables, les revenus à distribuer, les sommes à payer pour les investissements achetés et les sommes à payer pour les actions de compartiments à racheter sont évaluées à leur valeur nominale.

Les gains et pertes réalisés sur la cession d'investissements sont calculés selon la méthode du coût moyen et sont reflétés dans la section Compte de résultat et évolution de l'actif net.

Annexe aux États Financiers suite

(b) Revenus/dépenses des placements

La Société tient compte des revenus de ses investissements de la manière suivante :

- ▶ les intérêts créditeurs sont calculés quotidiennement et comprennent l'amortissement de la surcote/décote selon la méthode linéaire ;
- ▶ les intérêts sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie, les dépôts à terme, les revenus des organismes de placement collectif et les dépôts du marché monétaire sont comptabilisés selon la comptabilité d'engagement ;
- ▶ les produits de dividendes sont constatés à la date ex-dividende et après déduction de la retenue à la source ;
- ▶ les revenus sur prêt de titres sont comptabilisés selon la comptabilité d'exercice ;
- ▶ lorsqu'une obligation a été identifiée comme étant défaillante, l'accumulation des intérêts sur le titre défaillant est interrompue. Sur confirmation de la défaillance par les parties concernées, le montant recevable est sorti du bilan ;
- ▶ les demandes de remboursement de la retenue à la source sont comptabilisées sur la base des recettes en espèces ;
- ▶ la date indiquée dans la description de toute obligation perpétuelle, dans le portefeuille de titres, est la prochaine date de recouvrabilité des obligations, et le taux d'intérêt indiqué sous la description, dans le portefeuille de titres, est le taux d'intérêt applicable à la fin de l'exercice et n'est donné qu'à titre indicatif, puisque ces obligations portent un intérêt à taux variable.

Les frais de rendements négatifs en relation avec un taux d'intérêt négatif sur les actifs détenus sont cumulés quotidiennement et comptabilisés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net tout au long du cycle de vie de l'instrument sous-jacent.

(c) Instruments financiers dérivés

Au cours de l'exercice, les Compartiments ont conclu un certain nombre de contrats de change à terme et de contrats à terme (futures) sur instruments financiers. Les contrats de change à terme et les contrats à terme sur instruments financiers en cours sont évalués au coût de clôture à la date d'évaluation. Les gains/pertes issus de ces contrats non réglés sont portés au poste plus-values/moins-values non réalisées et sont inclus dans les Autres éléments de l'actif ou Autres éléments du passif (selon le cas) dans le Bilan.

Les Compartiments peuvent vendre des options d'achat et de vente couvertes et acheter des options d'achat et de vente. Les Compartiments peuvent également investir dans des options de spread et des options « cap » synthétiques. Une option de spread est un type d'option qui tire sa valeur de la différence entre les prix de deux actifs ou plus. Une option « cap » synthétique est un contrat entre deux parties prévoyant

pour l'acheteur un plafond du taux d'intérêt ou « cap » sur le paiement de l'intérêt. Le « cap » du taux prévoit lui-même un paiement périodique fondé sur le montant positif duquel le taux de l'indice de référence excède le taux d'exercice. Lorsque les Compartiments vendent et/ou achètent une option, un montant égal à la prime reçue ou payée par les Compartiments apparaît en tant que passif ou actif. Le passif correspondant à une option vendue et l'actif correspondant à une option achetée sont ensuite évalués aux prix du marché afin de refléter la valeur en cours de l'option. Les Administrateurs ont décidé de valoriser les options cotées en bourse en fonction des cours moyens ou des prix de règlement plutôt qu'en fonction des derniers cours négociés, puisque cette méthode reflète mieux leur valeur de réalisation estimée. Les options non cotées en bourse sont quotidiennement valorisées aux prix obtenus par des agents d'évaluation tiers. Lorsqu'un titre est vendu à travers l'exercice d'une option, la prime reçue (ou payée) est déduite de (ou ajoutée à) la base du titre vendu. Lorsqu'une option expire (ou que les Compartiments effectuent une opération de clôture), les Compartiments réalisent un profit ou une perte sur l'option dans la mesure des primes reçues ou payées (ou un profit ou une perte dans la mesure où le coût de l'opération de clôture est supérieur à la prime payée ou reçue).

Au 31 août 2023, les Compartiments ont conclu des Contrats sur différence (« CFD »). Les CFD permettent aux investisseurs de prendre des positions longues synthétiques ou des positions courtes synthétiques avec une marge variable. Avec les CFD, à la différence des actions, l'acheteur est potentiellement redevable d'un montant beaucoup plus élevé que le montant payé sur marge. Par conséquent, le Compartiment détient, en dépôt auprès de différents établissements comme indiqué dans le Prospectus, des liquidités confiées par les contreparties. Les positions en CFD prises sont sous réserve d'une charge financière quotidienne, appliquée à un taux préalablement convenu supérieur ou inférieur à l'indice de référence applicable. Les produits ou les charges pour dividendes apparaissent après déduction de la retenue à la source dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

La valeur de marché des CFD est déterminée par le dernier prix connu négocié à la bourse où les titres ou actifs sous-jacents sont négociés ou admis à la négociation. Pour les titres sous-jacents négociés sur des marchés clôturant après la valorisation, les derniers cours connus à ce moment ou à un autre moment peuvent être utilisés. La fluctuation de la valeur de marché, le cas échéant, est enregistrée en tant que variation nette des plus-values(/moins-values) non réalisées dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les gains ou les pertes réalisés à l'échéance ou à l'extinction des CFD sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Les gains et pertes sur les ventes de CFD ont été déterminés sur la base des coûts selon le principe du « premier entré, premier sorti ».

Les Compartiments ont conclu des contrats de swaps afin d'échanger le rendement généré par un instrument contre le rendement généré par un autre investissement. En cas de swaps de défaut de crédit (credit default swaps), une série

Annexe aux États Financiers suite

de primes est versée au vendeur de la protection, contre un paiement subordonné à un incident de crédit (prédéfini au contrat). Autant que possible, les swaps sont quotidiennement valorisés aux prix du marché obtenus par des agents d'évaluation tiers, et comparés à ceux du teneur de marché. Lorsque ces cotations ne sont pas disponibles, le prix des swaps est établi en fonction des cotations journalières du teneur de marché. Dans un cas comme dans l'autre, les cotations sont enregistrées en tant que plus-values/moins-values non réalisées dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Les gains et pertes réalisés à l'échéance ou à la résiliation des swaps ainsi que l'intérêt gagné ou à verser en relation avec les swaps sont présentés dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

Au cours de l'exercice, les Compartiments ont conclu des opérations de swaption. Ces derniers donnent à l'acheteur le droit, mais non l'obligation, de contracter un swap sur taux d'intérêt à un taux d'intérêt préétabli dans la limite d'une période déterminée. L'acheteur d'une swaption paie une prime au vendeur pour ce droit. Une swaption vendue donne à l'acheteur le droit de recevoir des paiements fixes contre le paiement d'un taux d'intérêt flottant. Une swaption achetée donne à l'acheteur le droit de payer un taux d'intérêt fixe contre la réception d'une suite de paiements à taux flottant. Lorsque le Compartiment vend/achète une swaption, un montant égal à la prime reçue/payée par le Compartiment est enregistré en tant que passif ou actif dans le Bilan.

Au cours de l'exercice, les Compartiments Dynamic High Income Fund, ESG Global Conservative Income Fund, ESG Global Multi-Asset Income Fund et Global Multi-Asset Income Fund ont acheté un certain nombre d'obligations indexées sur des actions. Un montant en principal est versé à un courtier au prix du marché d'une action sous-jacente à une date convenue en échange d'un ou de plusieurs paiements de coupon fixe. À l'échéance, le Compartiment recevra le principal plus (jusqu'à un plafond convenu dans l'accord) ou moins toute variation de la valeur du titre sous-jacent.

Les titres « À communiquer » (To Be Announced securities ou TBA) sont liés à des titres adossés à des prêts hypothécaires émis par des agences fédérales américaines. Habituellement, ces agences regroupent des prêts hypothécaires et vendent des participations dans les paniers créés. Les TBA sont liés aux futurs paniers de ces agences, qui sont achetés et vendus pour un règlement futur dont ni le taux d'intérêt ni la date d'échéance ne sont encore fixés. Les TBA sont indiqués séparément, dans le portefeuille de titres.

Les Compartiments peuvent se défaire d'un engagement avant le règlement, s'ils le jugent opportun. Les produits des ventes de titres AC ne peuvent être perçus avant la date de règlement stipulée au contrat. Pendant la durée de l'engagement de vente de titres AC, des titres livrables équivalents, ou un engagement compensatoire d'achat de titres AC (livrables à la date de l'engagement de vente ou avant), couvrent la transaction. Si deux contreparties ont des opérations de compensation pour le même contrat TBA, ces opérations seront compensées. Le jour du règlement, le vendeur livre les titres indiqués deux jours

plus tôt et reçoit les espèces indiquées à la date de l'opération. En pratique, la plupart des opérations TBA ne conduisent pas, à terme, à un transfert de MBS physique. Le vendeur soit dénouera soit « roulera » une opération en cours avant l'échéance, plutôt que de la régler physiquement.

Si l'engagement de vente de titres AC se conclut par l'acquisition d'un engagement d'achat compensatoire, le Compartiment réalise un bénéfice ou un déficit sur l'engagement, indépendamment de tout bénéfice ou déficit non réalisé sur le titre sous-jacent. Si le Compartiment livre des titres en vertu de l'engagement, il réalise un bénéfice ou un déficit sur la vente des titres en fonction du prix unitaire fixé à la date à laquelle l'engagement a été conclu.

Au 31 août 2023, les Compartiments avaient des TBA non réglés, compris dans les sommes à recevoir pour placements vendus et les placements achetés à payer, dans le Bilan.

Les valeurs de marché des TBA sont présentées dans le Bilan. La variation nette des plus-values ou moins-values non réalisées et les plus-values et moins-values réalisées sur les ventes de TBA sont présentées dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

(d) Change

Le cours des titres de placement libellés en une devise autre que la devise de référence des Compartiments a été converti au taux de change en vigueur au moment de l'achat. Les investissements et autres actifs libellés dans une devise autre que la devise de référence des Compartiments ont été convertis au taux de change en vigueur à Luxembourg aux heures d'évaluation respectives de ces Compartiments, le 31 août 2023.

(e) États financiers combinés

Les comptes de chaque Compartiment sont exprimés dans la devise de référence du Compartiment.

Les chiffres combinés de la Société sont exprimés en USD et comprennent le total des états financiers des différents Compartiments. Pour le Bilan, les taux de change en vigueur au point de valorisation au Luxembourg le 31 août 2023 sont :

Devise	EUR	GBP	JPY	CHF	CNH
USD	0,9217	0,7889	146,1550	0,8832	7,2754

Pour le compte de résultat et l'évolution de l'actif net, les taux de change correspondent au taux moyen calculé sur l'année :

Devise	EUR	GBP	JPY	CHF	CNH
USD	0,9424	0,8212	138,5231	0,9228	7,0339

Ces chiffres ne sont présentés qu'à titre d'information et sont arrondis à la quatrième décimale. Aux fins des états financiers, les taux de change à neuf décimales sont appliqués.

Annexe aux États Financiers suite

Les chiffres combinés dans la section Compte de résultat et évolution de l'actif net et dans le Bilan ont été calculés à l'aide des taux de change moyens tout au long de l'année. L'ajustement des taux de change obtenu, de 2.432.084.033 USD, représente la variation des taux de change entre le 31 août 2022 et le 31 août 2023. Il s'agit d'un montant notionnel, qui n'a aucun impact sur l'actif net de chacun des Compartiments.

(f) Taux de change

Les taux de change suivants ont été utilisés pour convertir les investissements et autres actifs et passifs libellés dans des devises autres que la devise de référence des Compartiments au 31 août 2023.

Devise	GBP	USD	EUR	JPY	CHF	CNH
AED	0,2148	0,2723	0,2509	39,7911	0,2405	1,9807
ARS	0,0023	0,0029	0,0026	0,4176	0,0025	0,0208
AUD	0,5110	0,6478	0,5970	94,6721	0,5721	4,7126
BRL	0,1601	0,2030	0,1871	29,6651	0,1793	1,4767
CAD	0,5831	0,7392	0,6813	108,0343	0,6528	5,3778
CHF	0,8932	1,1322	1,0436	165,4817	1,0000	8,2374
CLP	0,0009	0,0012	0,0011	0,1711	0,0010	0,0085
CNH	0,1084	0,1375	0,1267	20,0891	0,1214	1,0000
CNY	0,1082	0,1372	0,1264	20,0481	0,1211	1,0000
COP	0,0002	0,0002	0,0002	0,0356	0,0002	0,0018
CZK	0,0356	0,0451	0,0416	6,5916	0,0398	0,3281
DKK	0,1149	0,1456	0,1342	21,2793	0,1286	1,0592
DOP	0,0139	0,0176	0,0162	2,5722	0,0155	0,1280
EGP	0,0255	0,0324	0,0298	4,7299	0,0286	0,2354
EUR	0,8559	1,0849	1,0000	158,5701	0,9582	7,8934
GBP	1,0000	1,2677	1,1684	185,2734	1,1196	9,2226
GHS	0,0692	0,0877	0,0809	12,8206	0,0775	0,6382
HKD	0,1006	0,1275	0,1175	18,6351	0,1126	0,9276
HUF	0,0023	0,0029	0,0026	0,4170	0,0025	0,0208
IDR	0,0001	0,0001	0,0001	0,0096	0,0001	0,0005
ILS	0,2069	0,2623	0,2417	38,3335	0,2316	1,9082
INR	0,0095	0,0121	0,0111	1,7654	0,0107	0,0879
ISK	0,0060	0,0076	0,0070	1,1159	0,0067	0,0555
JPY	0,0054	0,0068	0,0063	1,0000	0,0060	0,0498
KES	0,0054	0,0069	0,0063	1,0045	0,0061	0,0500
KRW	0,0006	0,0008	0,0007	0,1106	0,0007	0,0055
KWD	2,5585	3,2433	2,9894	474,0267	2,8645	23,5963
KZT	0,0017	0,0022	0,0020	0,3189	0,0019	0,0159
LKR	0,0025	0,0031	0,0029	0,4582	0,0028	0,0228
MXN	0,0471	0,0598	0,0551	8,7332	0,0528	0,4347
MYR	0,1700	0,2155	0,1986	31,4989	0,1903	1,5680
NGN	0,0010	0,0013	0,0012	0,1887	0,0011	0,0094
NOK	0,0741	0,0939	0,0866	13,7249	0,0829	0,6832
NZD	0,4692	0,5947	0,5482	86,9257	0,5253	4,3270
PEN	0,2140	0,2713	0,2500	39,6476	0,2396	1,9736
PHP	0,0139	0,0177	0,0163	2,5813	0,0156	0,1285
PLN	0,1915	0,2428	0,2238	35,4824	0,2144	1,7663
QAR	0,2167	0,2747	0,2532	40,1524	0,2426	1,9987
RON	0,1732	0,2196	0,2024	32,0942	0,1939	1,5976
RUB	0,0082	0,0104	0,0096	1,5230	0,0092	0,0758

Devise	GBP	USD	EUR	JPY	CHF	CNH
SAR	0,2103	0,2666	0,2457	38,9680	0,2355	1,9398
SEK	0,0723	0,0917	0,0845	13,3974	0,0810	0,6669
SGD	0,5836	0,7398	0,6819	108,1257	0,6534	5,3823
THB	0,0225	0,0286	0,0263	4,1738	0,0252	0,2078
TRY	0,0296	0,0375	0,0346	5,4871	0,0332	0,2731
TWD	0,0248	0,0314	0,0289	4,5894	0,0277	0,2285
UAH	0,0214	0,0271	0,0250	3,9644	0,0240	0,1973
USD	0,7889	1,0000	0,9217	146,1550	0,8832	7,2754
UYU	0,0210	0,0266	0,0245	3,8845	0,0235	0,1934
VND	0,0000	0,0000	0,0000	0,0061	0,0000	0,0003
ZAR	0,0420	0,0532	0,0491	7,7783	0,0470	0,3872
ZMW	0,0391	0,0495	0,0456	7,2371	0,0437	0,3603

Le renminbi est soumis à des restrictions de change et n'est pas une monnaie librement convertible. Le taux de change utilisé pour le Compartiment China Bond Fund est lié au renminbi offshore (« CNH »), et non au renminbi onshore (« CNY »). La valeur du CNH peut être différente, parfois de manière significative, de la valeur du CNY, en raison d'un certain nombre de facteurs comprenant, mais de façon non limitative, les politiques de contrôle des changes et les restrictions en matière de rapatriement appliquées par le gouvernement chinois, le cas échéant, et en raison d'autres tendances du marché externe. Toute divergence entre le CNH et le CNY peut avoir un impact défavorable sur les investisseurs.

(g) Dilution

Les Administrateurs peuvent ajuster la Valeur Liquidative (« VL ») par Action, pour un Compartiment, afin de réduire l'effet de la « dilution » sur ce Compartiment. Il y a dilution lorsque le coût réel d'achat ou de vente des actifs sous-jacents d'un Compartiment diffère de la valeur comptable de ces actifs dans le Compartiment, en raison de facteurs tels que des frais de négociation et de courtage, des impôts et droits, un mouvement du marché et tout écart entre les prix d'achat et de vente des actifs sous-jacents. La dilution peut avoir un effet défavorable sur la valeur d'un Compartiment et, par conséquent, avoir un impact sur les Actionnaires. En ajustant la VL par Action, cet effet peut être réduit ou évité, et les Actionnaires peuvent être protégés de cet impact de la dilution. Les Administrateurs peuvent ajuster la VL d'un Compartiment si, lors d'un Jour de Négociation donné, le volume de l'ensemble des transactions effectuées sur des Actions de toute Catégorie de ce Compartiment entraîne une augmentation ou une diminution nette des Actions dépassant un ou plusieurs seuils arrêtés par les Administrateurs pour ce Compartiment. Le montant pour lequel la VL d'un Compartiment peut être ajustée un Jour de négociation donné est lié au coût attendu des opérations de marché pour ce Compartiment. Dans ces circonstances, la VL du Compartiment concerné peut être ajustée d'un montant n'excédant pas 1,50 %, ou 3 % dans le cas des Compartiments de titres à revenu fixe, de la VL. Dans des circonstances exceptionnelles, les Administrateurs peuvent, dans l'intérêt des Actionnaires, décider d'augmenter temporairement le facteur d'ajustement dilutif maximal indiqué ci-dessus et d'en informer les investisseurs. L'ajustement sera opéré à la

Annexe aux États Financiers suite

hausse, si le mouvement net entraîne une augmentation de la valeur de toutes les Actions du Compartiment, et à la baisse, s'il entraîne une diminution. Certains marchés d'actions et certaines juridictions pouvant avoir des structures de facturation différentes côté achat et côté vente, plus particulièrement en ce qui concerne les droits et impôts, l'ajustement qui en découle peut être différent pour les souscriptions (encaissements) nets et pour les rachats (décaissements) nets. De plus, les Administrateurs peuvent également décider d'inclure des charges fiscales extraordinaires dans le montant de l'ajustement. Ces charges fiscales extraordinaires varient d'un marché à l'autre et il est actuellement prévu qu'elles ne dépassent pas 2,5% de la VL. Si un Compartiment investit essentiellement dans certains types d'actifs, comme des obligations d'État ou des titres sur un marché monétaire, les Administrateurs peuvent décider qu'un tel ajustement n'est pas approprié.

Au 31 août 2023, conformément au Prospectus, Annexe B, 17.3, un tel ajustement dilutif a été appliqué aux Compartiments Emerging Markets Equity Income Fund, Global Government Bond Fund, Nutrition Fund et Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund. Au cours de l'exercice clos le 31 août 2023, un tel ajustement de dilution a été appliqué à tous les Compartiments, à l'exception des Compartiments Brown To Green Materials Fund, China Multi-Asset Fund, Climate Action Multi-Asset Fund, Dynamic High Income Fund, Emerging Europe Fund, Euro Reserve Fund, Future Consumer Fund, Global Allocation Fund, Global Multi-Asset Income Fund, Impact Bond Fund, Sustainable Energy Fund et US Dollar Reserve Fund.

La VL par action publiée/négociée est indiquée dans le Récapitulatif des valeurs liquidatives sur trois ans et peut comprendre un ajustement pour dilution. Cet ajustement n'est pas constaté dans le Bilan ni dans la section intitulée Compte de résultat et évolution de l'actif net.

(h) Frais de transaction

Les coûts de transaction sont des coûts incrémentiels directement attribuables à l'acquisition, à l'émission ou à la cession de titres. Un coût incrémentiel est un coût qui ne serait pas appliqué si l'entité n'avait pas acquis, émis ou cédé le titre. Lorsqu'un titre est initialement constaté, il est évalué à sa valeur de marché, plus les coûts de transaction directement attribuables à l'acquisition ou à l'émission du titre.

Les coûts de transaction, à l'exclusion des commissions par opération du dépositaire pour l'achat ou la vente de titres, sont compris dans les plus-values/(moins-values) nettes ou dans la variation nette des plus-values/(moins-values), dans la section intitulée Compte de résultat et évolution de l'actif net de chaque Compartiment. Les commissions par opération du dépositaire sont comprises dans les commissions du dépositaire dans la section Compte de résultat et évolution de l'actif net du Compartiment, et figurent aussi au point 17.

(i) Devises étrangères sur autres opérations

Les devises étrangères sur autres opérations correspondent aux plus-values/(moins-values) non réalisées sur les soldes de trésorerie et les contrats au comptant.

(j) Juste évaluation

Les titres évalués à leur juste valeur sont mis en évidence par un signe « ** » dans le portefeuille de titres.

Au 31 août 2023, cette juste évaluation a été appliquée selon le tableau ci-dessous :

Compartiment	Devise	Valeur de marché des titres évalués à leur juste valeur	% de l'actif net
Asian Dragon Fund ^o	USD	-	0,00
Asian High Yield Bond Fund	USD	4.094.752	0,27
Asian Multi-Asset Income Fund	USD	3.273	0,01
Asian Tiger Bond Fund ^o	USD	-	0,00
China Bond Fund	CNH	174.076.678	0,67
Climate Action Multi-Asset Fund	EUR	12.275	0,03
Continental European Flexible Fund	EUR	101.097.470	1,90
Dynamic High Income Fund	USD	1.919.794	0,07
Emerging Europe Fund	EUR	13.419.068	5,05
Emerging Markets Bond Fund ^o	USD	-	0,00
Emerging Markets Corporate Bond Fund ^o	USD	-	0,00
Emerging Markets Equity Income Fund	USD	2.216.502	1,08
Emerging Markets Fund	USD	18.669.235	0,74
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	USD	9.225.758	0,57
Emerging Markets Sustainable Equity Fund	USD	85.712	0,11
ESG Global Conservative Income Fund	EUR	562.251	0,15
ESG Global Multi-Asset Income Fund	USD	219.762	0,14
ESG Multi-Asset Fund	EUR	17.345.573	0,29
European High Yield Bond Fund	EUR	23.525	0,01
FinTech Fund	USD	4.317.829	1,69
Fixed Income Global Opportunities Fund	USD	61.194.034	0,85
Global Allocation Fund	USD	353.722.446	2,45
Global Dynamic Equity Fund	USD	9.489.940	2,32
Global High Yield Bond Fund	USD	2.069.711	0,13
Global Multi-Asset Income Fund	USD	2.739.828	0,06
Natural Resources Fund ⁽⁷⁾	USD	1.151.822	0,31
Next Generation Health Care Fund	USD	2.012	0,01
Next Generation Technology Fund	USD	74.317.592	2,90
Nutrition Fund	USD	1	0,00
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	USD	126.373	0,29
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund ^o	USD	-	0,00
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	USD	1.162.092	0,23
Sustainable Energy Fund ^o	USD	-	0,00
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	EUR	568.140	0,11
Sustainable Global Bond Income Fund	USD	194.816	0,17
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund ⁽⁴⁾	USD	1.135.492	0,44
United Kingdom Fund ^o	GBP	-	0,00
US Dollar Bond Fund ^o	USD	-	0,00

Annexe aux États Financiers suite

Compartiment	Devise	Valeur de marché des titres évalués à leur juste valeur	% de l'actif net
US Dollar High Yield Bond Fund	USD	5.185.888	0,27
World Energy Fund	USD	706	0,00
World Financials Fund	USD	1.816	0,00
World Gold Fund	USD	65.085.124	1,64
World Healthscience Fund	USD	738.839	0,01
World Mining Fund	USD	75.794.633	1,40
World Technology Fund	USD	158.627.390	1,62

^o Le Compartiment détient des titres évalués à la juste valeur dont la valeur de marché est égale à zéro.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Dans le cas où un titre ou un actif déterminé ne peut pas être évalué selon les méthodes visées ci-dessus, ou si le Conseil d'administration de la Société estime qu'une autre méthode d'évaluation reflète plus fidèlement la juste valeur de ce titre ou de cet actif par rapport au but recherché, la méthode d'évaluation de ce titre ou de cet actif sera, à sa discrétion, arrêtée par le Conseil d'administration de la Société. Des écarts dans la valeur des titres peuvent être constatés, par exemple lorsque les marchés sous-jacents sont fermés au public au moment du calcul de la VL de certains Compartiments ou lorsque les gouvernements décident d'imposer des charges fiscales ou des frais de négociation sur les investissements étrangers. Le Conseil d'administration de la Société peut fixer certains seuils dont le dépassement entraînera un ajustement de la VL en appliquant une indexation spécifique. Le Conseil d'administration de la Société délègue l'évaluation des investissements à la haute direction de la Société de gestion.

(k) Engagements des Sociétés d'acquisition à vocation spécifique

Les Sociétés d'acquisition à vocation spécifique (« SPAC » pour Special purpose acquisition companies) sont des sociétés qui n'ont aucune activité opérationnelle et qui font appel à l'épargne publique en vue de fusionner ou d'acquérir une société en utilisant le produit de l'introduction en bourse des SPAC. Les Compartiments peuvent contracter un engagement avec une SPAC pour un investissement privé dans une opération de placement privé d'actions (« PPA ») et rempliront cet engagement si et quand la SPAC achève sa fusion ou son acquisition. Les titres achetés par le biais d'opérations PPA ne pourront être négociés et seront considérés comme illiquides jusqu'à ce qu'une déclaration d'enregistrement des actions soit déposée et déclarée effective.

Les engagements SPAC PPA non financés sont évalués au prix du marché et les plus-values/moins-values résultant de ces engagements sont comptabilisées sous le poste « Plus-values (/moins-values) sur engagements SPAC PPA non financés » du Bilan et sous le poste « Variation nette des plus-values (/moins-values) sur engagements SPAC PPA non financés » du compte de résultat et l'évolution de l'actif.

3. Société de gestion

BlackRock (Luxembourg) S.A. a été nommée par la Société pour exercer en tant que Société de Gestion. La Société de Gestion, une société anonyme luxembourgeoise, est autorisée à agir en qualité de société de gestion, conformément au Chapitre 15 de la Loi de 2010.

La Société a signé un contrat de société de gestion avec la Société de Gestion. En vertu de ce contrat, la Société de Gestion se voit confier la gestion quotidienne de la Société ainsi que la responsabilité de l'exécution directe, ou par voie de délégation, des opérations liées à la gestion de portefeuilles de la Société, à son administration et à la commercialisation des Compartiments.

En accord avec la Société, la Société de Gestion a décidé de déléguer plusieurs de ses fonctions, comme qu'indiqué ultérieurement dans le Prospectus.

BlackRock (Luxembourg) S.A. est une filiale à 100 % du BlackRock Group. Elle est réglementée par la CSSF.

4. Commissions de Gestion

Durant l'exercice, la Société a versé des commissions de gestion à la Société de Gestion, BlackRock (Luxembourg) S.A.

La Société versera une commission de gestion à un taux annuel tel qu'indiqué à l'Annexe E du Prospectus. Le niveau des commissions de gestion varie entre 0,00 % et 1,75 %, et variera en fonction du Compartiment et de la catégorie d'actions auxquels appartiennent les titres achetés par l'investisseur. Ces commissions courent de jour en jour, ont pour assiette la VL du Compartiment concerné (reflétant, le cas échéant, tout ajustement de la VL du Compartiment concerné, comme indiqué au paragraphe 17.3 de l'Annexe B du Prospectus) et sont payées mensuellement. Certains coûts et certaines commissions, notamment celles des Gestionnaires Financiers par délégation, sont payés à l'aide de la commission de gestion. Aucune commission de gestion n'est facturée pour les Actions de Catégorie J et de Catégorie X. En ce qui concerne les Actions de Catégorie SR, une commission unique est facturée (comprenant la commission de gestion et la Commission de service annuelle) parmi le montant des frais courants.

Pour aider à la réalisation des objectifs d'investissement des Compartiments de Réserve (Euro Reserve Fund et US Dollar Reserve Fund), dans certaines circonstances, par exemple lorsque les conditions du marché entraînent une diminution des rendements des investissements sous-jacents du Compartiment, la Société de Gestion peut décider de renoncer à son droit de percevoir la totalité des commissions de gestion auxquelles elle peut prétendre pour un jour en particulier ou pour plusieurs jours. La Société de Gestion peut exercer ce pouvoir sans préjudice de son droit à percevoir la totalité de la commission de gestion comptabilisée pour tous jours à venir.

La dispense de commission de gestion apparaît séparément des commissions de gestion dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net. Au cours de l'exercice, l'Euro Reserve Fund a fait l'objet d'une exonération des frais de gestion.

Annexe aux États Financiers suite

À compter du 9 mars 2022, le Conseil d'administration de la Société de gestion a renoncé à ses commissions de gestion au titre du Compartiment Emerging Europe Fund en raison de sa suspension.

Au cours de l'exercice, les Compartiments suivants ont fait l'objet d'une diminution de la commission de gestion pour les investissements dans des fonds cibles gérés par BlackRock :

Asian High Yield Bond Fund, Asian Tiger Bond Fund, China Bond Fund, China Fund, Climate Action Multi-Asset Fund, Dynamic High Income Fund, ESG Flex Choice Cautious Fund, ESG Flex Choice Growth Fund, ESG Flex Choice Moderate Fund, ESG Global Conservative Income Fund, ESG Global Multi-Asset Fund, ESG Multi-Asset Fund, ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund, Euro Bond Fund, Euro Corporate Bond Fund, Euro Short Duration Bond Fund, Fixed Income Global Opportunities Fund, Global Allocation Fund, Global High Yield Bond Fund, Global Inflation Linked Bond Fund, Global Multi-Asset Income Fund, Multi-Theme Equity Fund, Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund, Sustainable Global Bond Income Fund, Sustainable World Bond Fund, Swiss Small & MidCap Opportunities Fund et US Dollar High Yield Bond Fund.

Les commissions de gestion payables au 31 août 2023 sont comprises dans le Bilan, au poste Autres éléments du passif.

5. Commissions de distribution

La Société verse des commissions annuelles, telles qu'indiquées à l'Annexe E du Prospectus. Le niveau des commissions de distribution varie de 0,00 % à 1,25 %. Les Actions des Catégories A, D, I, J, S, X et Z ne donnent pas lieu à une commission de distribution. Les Actions de Catégorie C ne donnent pas lieu à une commission de distribution pour les Compartiments Euro Reserve Fund et US Dollar Reserve Fund. Ces commissions courent de jour en jour, ont pour assiette la VL du Compartiment concerné (reflétant, le cas échéant, tout ajustement de la VL du Compartiment concerné, comme indiqué au paragraphe 17.3 de l'Annexe B du Prospectus) et sont payées mensuellement.

La Société paie des commissions de distribution comme indiqué à la section Compte de résultat et évolution de l'actif net. Les commissions de distribution payables au 31 août 2023 sont comprises dans le Bilan, au poste Autres éléments du passif.

6. Commission de service annuelle

La Société verse une Commission de service annuelle à la Société de Gestion.

Le niveau de la Commission de service annuelle peut varier à la discrétion des Administrateurs, comme convenu avec la Société de Gestion. Il sera applicable à divers taux dans les différents Compartiments et les différentes Catégories d'Actions émis par la Société. Cependant, les Administrateurs et la Société de Gestion ont décidé d'un commun accord que la Commission de service annuelle actuellement versée ne devra pas dépasser 0,25 % par an. La commission court de jour en jour, a pour assiette la VL de la Catégorie d'Actions concernée (reflétant, le cas échéant, tout ajustement de la VL du Compartiment concerné, comme indiqué au paragraphe 17.3 de l'Annexe B du Prospectus) et est payée mensuellement.

Les Administrateurs et la Société de Gestion fixent le niveau de la commission de service annuelle à un taux visant à assurer que les frais courants de chaque Compartiment restent compétitifs en comparaison avec un vaste marché de produits d'investissement similaires offerts aux investisseurs dans les Compartiments, en tenant compte d'un certain nombre de critères comme le secteur marchand du Compartiment et la performance de ce dernier par rapport à ses homologues.

Le montant des frais courants correspond au total des dépenses par catégorie d'actions (en excluant les intérêts sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie, les coûts de transaction et les frais de rendements négatifs sur actifs financiers, et en incluant les subventions pour la commission de service annuelle) divisé par l'actif net moyen de la catégorie d'actions concernée, exprimé en pourcentage.

Le montant des frais courants des Compartiments Asian Multi-Asset Income Fund, Asian Sustainable Equity Fund, Brown To Green Materials Fund, China Impact Fund, China Innovation Fund, China Multi-Asset Fund, Circular Economy Fund, Climate Action Equity Fund, Developed Markets Sustainable Equity Fund, Emerging Europe Fund, Emerging Markets Bond Fund, Emerging Markets Corporate Bond Fund, Emerging Markets Local Currency Bond Fund, Emerging Markets Sustainable Equity Fund, ESG Flex Choice Cautious Fund, ESG Flex Choice Growth Fund, ESG Flex Choice Moderate Fund, ESG Global Multi-Asset Income Fund, ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund, European Focus Fund, European Sustainable Equity Fund, FinTech Fund, Future Consumer Fund, Future Of Transport Fund, Global Inflation Linked Bond Fund, Multi-Theme Equity Fund, Natural Resources Fund, Next Generation Health Care Fund, Next Generation Technology Fund, Nutrition Fund, Sustainable Asian Bond Fund, Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund, Sustainable Emerging Markets Bond Fund, Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund, Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund, Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund, Sustainable Global Allocation Fund, Systematic China A-Share Opportunities Fund, Systematic China Environmental Tech Fund, Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund, Systematic Sustainable Global SmallCap Fund, US Dollar Bond Fund et US Sustainable Equity Fund est plafonné, le delta étant compensé par la commission de service annuelle dans le Compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

La commission de service annuelle est utilisée par la Société de Gestion pour couvrir tous les coûts et dépenses de fonctionnement et d'administration, fixes et variables, supportés par la Société, à l'exception des commissions de dépositaire, des commissions de distribution, des commissions de prêts de titres et de tous coûts découlant d'emprunts (y compris, afin d'éviter toute ambiguïté, toute commission d'engagement qui pourrait être due au prêteur), ainsi que de tous les coûts associés aux demandes de remboursement de la retenue à la source de l'UE et hors UE (plus toutes taxes ou tous intérêts y afférents) et de toute taxe concernant les investissements ou la Société.

Annexe aux États Financiers suite

La Société paie tous frais professionnels liés aux demandes de remboursement de la retenue à la source de l'Union européenne. Tous frais liés aux demandes de remboursement de la retenue à la source seront répartis entre les Compartiments concernés sur une base juste et équitable. Étant donné que la Société a obtenu, à ce jour, un bon degré de succès s'agissant de ses demandes de remboursement de la retenue à la source de l'UE (qui sont payées par la Société), les coûts liés aux demandes de remboursement de la retenue à la source hors UE ne seront plus couverts par la Commission de service annuelle et seront payés par la Société et répartis entre les Compartiments concernés sur une base juste et équitable.

La commission de service annuelle est également utilisée pour couvrir les commissions versées à Ernst & Young S.A. pour la révision d'entreprise et les services liés aux rapports à l'intention des investisseurs et autres questions de conformité fiscale. Pour l'exercice clos le 31 août 2023, les commissions étaient de 827.695 EUR.

Ces dépenses de fonctionnement et d'administration comprennent toutes dépenses et autres coûts recouvrables d'un tiers, supportés par ou pour le compte de la Société, le cas échéant, y compris mais de façon non limitative les commissions d'agent comptable du compartiment, les commissions d'agent de transfert (notamment les frais de négociation du sous-agent de transfert et de la plate-forme associée), tous les coûts professionnels tels que les commissions de consultants, de conseillers juridiques et de conseillers fiscaux et les frais d'audits, les commissions des Administrateurs (pour les Administrateurs qui ne sont pas des employés du BlackRock Group), les frais de voyage, les débours raisonnables, les frais d'impression, de publication et de traduction et tous les autres coûts liés aux rapports aux actionnaires, les droits de dépôt et les droits de permis, les frais des banques correspondantes et autres frais bancaires, le support technique et l'entretien des logiciels, les coûts et dépenses opérationnels attribués aux équipes de Services aux Investisseurs et autres services d'administration globaux fournis par différentes sociétés du BlackRock Group.

La Société de Gestion assume le risque financier de veiller à ce que le total des frais courants d'un Compartiment reste compétitif. Par conséquent, la Société de Gestion est en droit de conserver tout montant de la Commission de service annuelle qui lui est versée et qui dépasserait les dépenses réelles supportées par la Société pendant une période donnée, considérant que tous coûts et dépenses supportés par la Société au cours d'une période donnée qui dépasseraient le montant de la Commission de service annuelle versé à la Société de Gestion seront à la charge de la Société de Gestion ou d'une autre société du BlackRock Group.

Les Administrateurs de la Société qui ne sont pas des employés du BlackRock Group reçoivent une rémunération annuelle brute comprise entre 55.000 EUR et 60.000 EUR. Les Administrateurs qui sont également des employés de BlackRock Group n'ont droit à aucune rémunération en tant qu'Administrateur.

L'impôt applicable dans certaines juridictions est également facturé directement aux Compartiments (voir point 8 de l'Annexe aux états financiers).

La commission de service annuelle est indiquée dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net.

La commission de service annuelle payable au 31 août 2023 est comprise dans le Bilan, au poste Autres éléments du passif.

7. Commissions du Dépositaire

Tout au long de l'exercice, le Dépositaire de la Société était The Bank of New York Mellon SA/ NV, succursale luxembourgeoise. Le Dépositaire reçoit des commissions annuelles, en fonction de la valeur des titres, comptabilisées quotidiennement, plus des commissions par opération indiquées ultérieurement dans le Prospectus. Les taux de ces deux types de commissions varieront en fonction du pays d'investissement et, dans certains cas, de la catégorie d'actifs. Les investissements en obligations et sur les marchés d'actions des pays développés donneront lieu au taux de commission le plus bas, tandis que certains investissements sur des marchés émergents ou en développement donneront lieu au taux de commission le plus élevé. Dans ces conditions, les frais de conservation de chaque Compartiment dépendront de la ventilation de ses actifs au fil du temps.

Les commissions du dépositaire sont facturées directement aux Compartiments. Les commissions du Dépositaire payables au 31 août 2023 sont comprises dans le Bilan, au poste Autres éléments du passif.

8. Imposition Luxembourg

Selon la législation et la pratique luxembourgeoises actuelles, la Société n'est assujettie à aucun impôt luxembourgeois sur le revenu ou les plus-values, et les dividendes versés par la Société ne sont frappés d'aucune retenue à la source au Grand-Duché de Luxembourg. Cependant, la Société est soumise, au Luxembourg, à une taxe correspondant à 0,05 % p.a., ou, dans le cas des Compartiments Reserve Funds et des Actions de Catégorie I, de Catégorie J et de Catégorie X, de 0,01 % p.a. de sa VL. Cette taxe est payable chaque trimestre et son assiette est constituée par l'avoir net des Compartiments respectifs à la clôture du trimestre concerné. L'émission des Actions au Grand-Duché de Luxembourg n'est sujette ni à un droit de timbre ni à aucune autre taxe. Pour l'exercice clos le 31 août 2023, 57.945.011 USD ont été facturés au titre de la taxe luxembourgeoise.

Belgique

La Société est enregistrée auprès de la Commission bancaire et financière de Belgique en application de l'article 154 de la Loi du 3 août 2012 relative aux opérations financières et aux marchés financiers. Les fonds enregistrés à des fins de distribution publique en Belgique sont soumis à une taxe annuelle de 0,0925 % de la valeur liquidative des parts distribuées en Belgique via des intermédiaires belges au 31 décembre de l'année précédente. Pour l'exercice clos le 31 août 2023, 3.874.789 USD ont été facturés au titre de la taxe belge.

Annexe aux États Financiers suite

Royaume-Uni

Compartiments déclarants

Le régime des Compartiments déclarants au Royaume-Uni s'applique à la Société. Suivant ce régime, les personnes investissant dans des Fonds déclarants au Royaume-Uni sont imposables sur la part de revenu du Fonds déclarant au Royaume-Uni attribuable à leurs avoirs dans ce fonds, que le revenu soit distribué ou non, mais toute plus-value sur une cession de leurs avoirs est assujettie à un impôt sur les plus-values. Une liste des Compartiments qui possèdent actuellement le statut de Fonds Déclarant au Royaume-Uni est disponible à l'adresse <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>.

Autres taxes sur les transactions

D'autres pays peuvent imposer des taxes, taxes sur les transactions financières (« TTF ») ou autres taxes sur les transactions portant sur certains actifs détenus par les Compartiments (par exemple, les droits de timbre au Royaume-Uni et la TTF en France).

Retenue à la source

Les plus-values, dividendes et intérêts touchés par la Société au titre de ses investissements peuvent être soumis à des retenues à la source dans les pays d'origine, qui généralement ne peuvent être récupérées, puisque la Société elle-même est exonérée d'impôt sur les revenus. Cependant, un récent précédent en Union européenne pourrait réduire le montant de cette retenue non récupérable dans les pays de l'Union européenne. Les investisseurs sont invités à s'informer et, si nécessaire, à consulter leur conseiller sur les conséquences fiscales possibles de la souscription, de l'achat, de la détention, du rachat, de la conversion ou de la vente des Actions dans le pays dont ils sont ressortissants, ou dans lequel ils sont soit domiciliés soit résidents. Les investisseurs doivent prendre note du fait que l'assiette, les taux d'imposition ainsi que les exonérations fiscales existantes, peuvent changer. Les éventuels frais de retenue à la source sont indiqués de façon plus détaillée dans le Prospectus.

9. Gestionnaires Financiers par délégation

La Société de Gestion, BlackRock (Luxembourg) S.A., a délégué ses fonctions de gestion des investissements aux gestionnaires financiers par délégation (dénommés individuellement « Gestionnaire Financier par délégation ») : BlackRock Financial Management, Inc. (US) (BFM), BlackRock Investment Management, LLC (US) (BIMLLC), BlackRock Investment Management (UK) Limited (BIMUK) et BlackRock (Singapore) Limited (BSL), comme indiqué dans le Prospectus.

Tous les Gestionnaires Financiers par délégation sont nommés directement par BlackRock (Luxembourg) S.A. Tous les Sous-Gestionnaires Financiers par délégation sont nommés par le Gestionnaire Financier par délégation concerné. Certains d'entre eux, en tant que Gestionnaires Financiers par délégation, ont sous-délégué à leur tour certaines fonctions à BlackRock Japan Co. Limited (BLKJap), BlackRock Asset Management North Asia Limited (BAMNA) et BlackRock Investment Management (Australia) Limited (BLKAus, BIMAL).

Compartiment	Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation	Gestionnaire(s) délégué(s)
Asian Dragon Fund	BIMUK	BAMNA
Asian Growth Leaders Fund	BIMUK	BAMNA
Asian High Yield Bond Fund	BSL	–
	BIMUK, BSL,	BAMNA,
Asian Multi-Asset Income Fund	BIMLLC	BLKAus
Asian Sustainable Equity Fund*	BIMUK	BAMNA
Asian Tiger Bond Fund	BIMUK, BSL	BAMNA
Brown To Green Materials Fund ⁽²⁾ *	BIMUK	–
China Bond Fund	BIMUK, BSL	BAMNA
China Flexible Equity Fund	BIMUK	BAMNA
China Fund	BIMUK	BAMNA
China Impact Fund*	BIMUK	BAMNA
China Innovation Fund	BIMUK, BIMLLC	BAMNA,
		BANMA,
China Multi-Asset Fund ⁽²⁾ *	BSL, BFM	BLKAus
China Onshore Bond Fund ⁽²⁾	BSL	–
Circular Economy Fund	BIMUK	–
Climate Action Equity Fund*	BIMUK	–
Climate Action Multi-Asset Fund*	BIMUK	–
Continental European Flexible Fund	BIMUK	–
Developed Markets Sustainable Equity Fund*	BIMUK	–
Dynamic High Income Fund	BIMUK, BFM, BSL	BAMNA, BIMAL
Emerging Europe Fund ⁽³⁾	BIMUK	–
Emerging Markets Bond Fund	BIMUK, BSL, BFM	–
Emerging Markets Corporate Bond Fund	BIMUK, BSL, BFM	–
Emerging Markets Equity Income Fund	BIMUK, BIMLLC	BAMNA
Emerging Markets Fund	BIMUK, BIMLLC	BAMNA
Emerging Markets Impact Bond Fund*	BIMUK, BIMLLC	–
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	BIMUK, BSL, BFM	BAMNA
Emerging Markets Sustainable Equity Fund*	BIMUK	–
ESG Flex Choice Cautious Fund	BIMUK	BAMNA
ESG Flex Choice Growth Fund	BIMUK	BAMNA
ESG Flex Choice Moderate Fund	BIMUK	BAMNA
ESG Global Conservative Income Fund*	BFM, BIMUK	–
	BIMUK, BIMLLC,	
ESG Global Multi-Asset Income Fund*	BSL, BFM	BAMNA
	BIMUK, BIMLLC,	
ESG Multi-Asset Fund	BFM, BSL	BIMAL
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾ *	BIMLLC, BIMUK,	–
	BFM	
Euro Bond Fund	BIMUK, BSL	BIMAL
Euro Corporate Bond Fund	BIMUK	–
Euro Reserve Fund	BIMUK	–
Euro Short Duration Bond Fund	BIMUK, BSL	BIMAL
Euro-Markets Fund	BIMUK	–
European Equity Income Fund	BIMUK	–
European Focus Fund*	BIMUK	–
European Fund	BIMUK	–
European High Yield Bond Fund	BIMUK	–
European Special Situations Fund	BIMUK	–
European Sustainable Equity Fund*	BIMUK	–
European Value Fund	BIMUK	–
FinTech Fund	BIMUK	–
Fixed Income Global Opportunities Fund	BIMUK, BFM, BSL	BLKAus
Future Consumer Fund*	BIMUK	–
Future Of Transport Fund	BIMUK	–
Global Allocation Fund	BIMLLC, BSL	–
Global Corporate Bond Fund	BIMUK, BSL, BFM	–
Global Dynamic Equity Fund	BIMLLC	–
Global Equity Income Fund	BIMUK	–
Global Government Bond Fund	BIMUK, BSL, BFM	BIMAL
Global High Yield Bond Fund	BIMUK, BSL, BFM	–
Global Inflation Linked Bond Fund	BIMUK, BFM	–
Global Long-Horizon Equity Fund	BIMUK, BIMLLC	–
Global Multi-Asset Income Fund	BIMUK, BFM, BSL	BAMNA, BIMAL

Annexe aux États Financiers suite

Compartiment	Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation	Gestionnaire(s) délégué(s)
Impact Bond Fund ^{(2), *}	BIMUK, BFM	–
India Fund	BIMUK, BSL	BAMNA
		BAMNA,
		BLKJap
Japan Flexible Equity Fund	BIMUK	BLKJap
Japan Small & MidCap Opportunities Fund	BIMUK	BLKJap
Latin American Fund	BIMUK, BIMLLC	–
Multi-Theme Equity Fund*	BIMUK	–
Natural Resources Fund ⁽⁷⁾	BIMUK, BIMLLC	–
Next Generation Health Care Fund	BIMLLC	–
Next Generation Technology Fund	BIMLLC	–
Nutrition Fund	BIMUK	–
Sustainable Asian Bond Fund	BSL	–
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund*	BIMUK, BFM	–
Sustainable Emerging Markets Bond Fund*	BIMUK, BFM	–
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund*	BIMUK, BFM	–
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund*	BIMUK, BFM	–
Sustainable Energy Fund	BIMUK	–
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund*	BIMUK, BSL, BFM	BLKAus
Sustainable Global Allocation Fund ^{(2), *}	BIMUK, BIMLLC	–
Sustainable Global Bond Income Fund	BIMUK, BFM	–
	BIMUK, BIMLLC,	
	BSL	BLKAus
Sustainable Global Infrastructure Fund	BIMUK, BFM, BSL	BIMAL
Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾		
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund ⁽⁵⁾	BIMUK	–
Systematic China A-Share Opportunities Fund	BIMLLC	–
Systematic China Environmental Tech Fund ^{(2), *}	BIMLLC, BFM	–
Systematic Global Equity High Income Fund	BIMUK	–
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund ⁽²⁾	BIMUK, BFM	–
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund ⁽⁴⁾	BIMLLC	–
United Kingdom Fund	BIMUK	–
US Basic Value Fund	BIMLLC	–
US Dollar Bond Fund	BIMUK, BSL, BFM	–
US Dollar High Yield Bond Fund	BFM	–
US Dollar Reserve Fund	BFM	–
US Dollar Short Duration Bond Fund	BFM	–
US Flexible Equity Fund	BIMLLC	–
US Government Mortgage Impact Fund	BFM	–
US Growth Fund	BIMLLC	–
US Mid-Cap Value Fund	BIMLLC	–
US Sustainable Equity Fund*	BIMLLC	–
World Energy Fund	BIMUK	–
World Financials Fund	BIMUK	–
World Gold Fund	BIMUK	–
World Healthscience Fund	BIMLLC	–
World Mining Fund	BIMUK	–
	BIMUK, BIMLLC,	
	BSL	BIMAL
World Real Estate Securities Fund		
World Technology Fund	BIMLLC	–

Compartiment	Gestionnaire(s) Financier(s) par délégation	Gestionnaire(s) délégué(s)
--------------	---	----------------------------

* Au 31 août 2023, le Compartiment n'est pas autorisé à Hong Kong et n'est pas proposé au public à Hong Kong.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

10. Transactions avec des affiliées

La société holding faîtière de la Société de Gestion, du Distributeur Principal, des Gestionnaires Financiers par délégation et des Sous-Gestionnaires Financiers par délégation est BlackRock, Inc., société de l'État du Delaware, aux États-Unis. Au cours de l'exercice, aucune transaction de la Société n'a été effectuée par l'intermédiaire d'un courtier qui est une affiliée de la Société de Gestion, des Gestionnaires Financiers par délégation, des Sous-Gestionnaires Financiers par délégation ou des Administrateurs de la Société. La Société n'a conclu aucune transaction avec la Société de Gestion, les Gestionnaires Financiers par délégation, les Gestionnaires délégués ou les Administrateurs de la Société ou l'une de leurs personnes rattachées en tant que principal au cours de l'exercice.

Lorsque des Compartiments investissent dans des parts d'autres OPCVM et/ou autres organismes de placement collectif (« OPC ») qui sont gérés, directement ou par voie de délégation, par le Gestionnaire Financier par délégation ou par toute autre société à laquelle le Gestionnaire Financier par délégation est lié par une gestion ou un contrôle commun, ou par une importante participation directe ou indirecte, aucune commission de souscription ou de rachat ne peut être facturée à la Société au titre de son investissement dans les parts de ces autres OPCVM et/ou OPC. Les Compartiments investiront, si possible, dans des Actions de Catégorie X qui ne sont soumises à aucune commission de gestion. Ces investissements sont indiqués par un « ~ » dans le portefeuille d'investissements du Compartiment.

Lorsqu'un Compartiment investit une part importante de son actif net dans d'autres OPCVM et/ou d'autres OPC, le Gestionnaire Financier par délégation veillera à ce que la totalité de la commission de gestion (à l'exclusion de toute commission de performance, s'il y a lieu) facturée à ce Compartiment (y compris les commissions de gestion des autres OPCVM et OPC dans lesquels il investit) ne soit pas supérieure à 1,50% de la valeur liquidative du Compartiment.

Au cours de l'exercice, aucune transaction n'a eu lieu, en dehors du cadre ordinaire de l'activité ou à des conditions autres que les conditions d'usage, entre la Société, la Société de Gestion, les Gestionnaires Financiers par délégation, les Gestionnaires délégués, les Administrateurs de la Société, le Dépositaire ou toute entité dont ces parties ou leurs affiliées possèdent une participation importante.

À la fin de l'exercice, Keith Saldanha, un Administrateur de la Société, détenait les actions suivantes :

Annexe aux États Financiers suite

Compartiment	Catégorie d'Actions	Nombre d'actions	Valeur
China Bond Fund	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	493	GBP 4.087
China Fund	Action de capitalisation de Catégorie D couverte en EUR	593	EUR 7.377
Future Of Transport Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	644	GBP 8.836
Next Generation Technology Fund	Action de capitalisation de Catégorie D	1.228	USD 20.127
Sustainable Energy Fund	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	409	USD 7.063
World Mining Fund	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	82	USD 4.369

Aucun autre Administrateur ne détenait d'actions dans l'un des Compartiments.

L'agent de prêt de titres nommé conformément au contrat de prêt de titres est BlackRock Advisors (UK) Limited, qui est une partie liée à la Société. BlackRock Advisors (UK) Limited supporte tous les coûts opérationnels directement liés aux transactions de prêt de titres.

Les Compartiments bénéficient également d'une indemnité en cas de défaut de l'emprunteur, fournie par BlackRock, Inc. L'indemnité permet le remplacement complet des titres en prêt. BlackRock, Inc. prend en charge le coût de l'indemnisation en cas de défaut de l'emprunteur.

BlackRock Investment Management (UK) Limited a nommé BlackRock (Channel Islands) Limited pour fournir certains services administratifs.

Certains Compartiments utilisent des techniques d'investissement croisés, c'est-à-dire que les Compartiments investissent dans d'autres Compartiments du fonds à compartiments multiples.

Le bilan combiné ainsi que le compte de résultat et l'évolution de l'actif net combinés n'ont pas été ajustés pour éliminer l'impact des investissements croisés.

Les Compartiments suivants détenaient, au 31 août 2023, des investissements croisés sous forme de fonds à compartiments multiples, indiqués par un « ∞ » dans le Portefeuille d'investissements du Compartiment, dont la valeur de marché représente 0,12 % de l'actif net combiné.

Compartiment	Investissements croisés de fonds à compartiments multiples	Devise	Valeur de marché	% de l'actif net
Asian Tiger Bond Fund	BlackRock Global Funds - China Onshore Bond Fund	USD	16.694.345	0,60
Asian Tiger Bond Fund	BlackRock Global Funds - Sustainable Asian Bond Fund	USD	5.057.310	0,18

Compartiment	Investissements croisés de fonds à compartiments multiples	Devise	Valeur de marché	% de l'actif net
China Multi-Asset Fund ⁽²⁾	BlackRock Global Funds - China Impact Fund	USD	1.496.369	7,67
China Multi-Asset Fund ⁽²⁾	BlackRock Global Funds - China Onshore Bond Fund	USD	3.473.620	17,81
China Multi-Asset Fund ⁽²⁾	BlackRock Global Funds - Systematic China Environmental Tech Fund	USD	1.508.792	7,73
Dynamic High Income Fund	BlackRock Global Funds - US Dollar High Yield Bond Fund	USD	8.259.286	0,29
Emerging Markets Bond Fund	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Corporate Bond Fund	USD	45.988.800	4,68
ESG Global Multi-Asset Income Fund	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Impact Bond Fund	USD	27.573	0,02
Global Multi-Asset Income Fund	BlackRock Global Funds - US Dollar High Yield Bond Fund	USD	39.769.131	0,82
Multi-Theme Equity Fund	BlackRock Global Funds - Circular Economy Fund	USD	24.740.745	15,06
Multi-Theme Equity Fund	BlackRock Global Funds - FinTech Fund	USD	6.619.644	4,03
Multi-Theme Equity Fund	BlackRock Global Funds - Next Generation Technology Fund	USD	1.663.622	1,01
Multi-Theme Equity Fund	BlackRock Global Funds - Nutrition Fund	USD	8.168.654	4,98
Multi-Theme Equity Fund	BlackRock Global Funds - Sustainable Energy Fund	USD	22.501.911	13,70
Sustainable Asian Bond Fund	BlackRock Global Funds - China Onshore Bond Fund	USD	3.384.154	3,01
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	BlackRock Global Funds - Sustainable Emerging Markets Bond Fund	EUR	1.924.613	0,38

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Au cours de l'exercice clôturé le 31 août 2023, The Bank of New York Mellon SA/NV, un affilié au Dépositaire, a agi dans le cadre des opérations de dépôt sur devises et des programmes d'administration des devises/de couverture pour les Compartiments. Le total des commissions versées au titre de ces transactions s'élevait à 12.356.665 USD, avec un taux de commission moyen de 0,16 pb payé à l'affilié. La valeur totale cumulée des transactions avec l'affilié au Dépositaire s'élevait à 782 milliards d'USD, ce qui représente 70 % de la valeur totale de la transaction conclue par les Compartiments. Toutes les transactions avec l'affilié au Dépositaire ont été conclues dans le cadre normal des activités et selon les conditions d'usage.

Annexe aux États Financiers suite

Autres remboursements

Au cours de l'exercice financier, certains Compartiments au sein de la Société ont reçu des remboursements d'une entité affiliée au BlackRock Group pour des pénalités facturées aux Compartiments par des Dépositaires centraux de titres en raison de retard de règlements de titres. Ces remboursements reçus en cours d'exercice par les Compartiments sont présentés à la rubrique «Autres remboursements» du Compte de résultat et évolution de l'actif net.

11. Utilisation des commissions

Lorsque la réglementation en vigueur le permet (à l'exclusion, afin d'éviter toute ambiguïté, de tous compartiments visés par la MiFID II), certaines sociétés du BlackRock Group agissant en tant que gestionnaire financier par délégation pour les compartiments peuvent accepter les commissions générées lors de négociations d'actions avec certains courtiers et dans certaines juridictions. Les commissions peuvent être ré-allouées pour acheter des services de recherche éligibles. De tels arrangements peuvent avantager un compartiment plutôt qu'un autre, car la recherche peut être utilisée pour une gamme de clients plus vaste que les seuls clients dont les négociations ont financé le Compartiment. BlackRock Group a mis en place une politique d'utilisation des commissions visant à assurer que seuls les services éligibles seront achetés et que les commissions excédentaires seront ré-allouées, le cas échéant, à un prestataire de services éligibles. Aucun accord en dollars assorti de conditions libérales n'a été conclu au cours de l'exercice.

12. Instruments financiers dérivés

Les Compartiments peuvent acheter et vendre des instruments financiers dérivés qui sont décrits plus en détail dans le Prospectus. Pour connaître les instruments financiers dérivés détenus au 31 août 2023, veuillez consulter le portefeuille de titres du Compartiment.

L'exposition sous-jacente, comme indiqué dans le portefeuille de titres, a été calculée conformément aux lignes directrices émises par l'AEMF et représente la valeur de marché d'une position équivalente dans les actifs sous-jacents de chaque instrument financier. L'exposition sous-jacente dans des contrats à terme sur obligations et contrats sur différence est calculée à partir de la valeur de marché des obligations plutôt que du titre le moins cher à livrer.

13. Titres mis en gage ou donnés en garantie et reçus en garantie

Les titres qui sont mis en gage ou donnés en garantie par les Compartiments sont indiqués dans le portefeuille de titres des Compartiments. Au 31 août 2023, la valeur de ces titres, mise en évidence à l'aide d'un signe « † » dans le portefeuille de titres du Compartiment, s'élève à 594.427.432 USD.

Pour le Compartiment Systematic Global Equity High Income Fund, la garantie sur les options d'achat est engagée en vertu d'un contrat tripartite entre BlackRock Investment Management (UK) Limited, Merrill Lynch International et Bank of New York Mellon (International) Limited. Au 31 août 2023, la valeur de la garantie, mise en évidence à l'aide d'un signe « ^ » dans le portefeuille de titres du Compartiment, s'élève à 110.910.266 USD.

Les titres reçus en garantie par les Compartiments sont indiqués dans le tableau ci-dessous. Au 31 août 2023, la valeur de ces titres atteint 1.549.571 USD.

Compartiment	Avoirs	Description	Devise	Valeur (USD)
Asian Tiger Bond Fund	366.000	United States Treasury Note/Bond 2,75 % 15/8/2047	USD	255.546
Asian Tiger Bond Fund	314.000	United States Treasury Note/Bond 2,875 % 15/5/2032	USD	276.501
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	457.000	United States Treasury Note/Bond 2,875 % 15/5/2032	USD	402.423
US Dollar Bond Fund	267.000	United States Treasury Note/Bond 0 % 4/1/2024	USD	259.985
US Dollar Bond Fund	439.000	United States Treasury Note/Bond 1,625 % 15/5/2031	USD	355.116

14. Garantie en numéraire

Les Compartiments négocient des instruments dérivés avec un éventail de contreparties. Les contreparties aux instruments dérivés sont indiquées dans le portefeuille de titres. Les dérivés sont négociés avec les contreparties suivantes : ANZ, Bank of America, Barclays, BNP Paribas, BNY Mellon, Citibank, Citigroup, Credit Agricole, Credit Suisse, Commonwealth Bank of Australia, Deutsche Bank, Goldman Sachs, HSBC Bank, JP Morgan, Morgan Stanley, Nomura, RBS, Royal Bank of Canada, Société Générale, Standard Chartered Bank, State Street, Toronto-Dominion, UBS et Westpac. La garantie/marge est payée ou reçue sur les contrats de swaps, les contrats sur différence (« CFD »), les contrats à terme, les options vendues (de vente et d'achat), les options achetées (de vente et d'achat) et les swaptions pour couvrir toute exposition de la Société due à la contrepartie, ou de la contrepartie due à la Société. Le poste « Dus par les courtiers » correspond à une garantie en numéraire payée aux courtiers de compensation du portefeuille et différentes contreparties. Le poste « Dus aux courtiers » correspond à une garantie en numéraire versée par les courtiers de compensation du portefeuille et différentes contreparties. Les contrats à terme dus par le courtier font partie des liquidités en banque et les contrats à terme dus au courtier font partie des liquidités dues à la banque dans l'état de l'actif net.

Le tableau ci-dessous indique les soldes de garantie en numéraire dus par les/(dus aux) courtiers, par rapport aux CFD, contrats de swaps et options OTC au 31 août 2023. Les soldes de trésorerie des futures correspondent aux liquidités détenues chez les courtiers et sont en partie utilisés pour satisfaire les exigences de marge au 31 août 2023.

Compartiment	Devise	Garantie en numéraire due par le courtier sur options OTC de CFD	Garantie en numéraire due au courtier sur options OTC de CFD	Contrats à terme dus par le courtier	Contrats à terme dus au courtier
Asian Growth Leaders Fund	USD	-	-	13	-

Annexe aux États Financiers suite

Compartiment	Devise	Garantie en numéraire due par le courtier sur options OTC sur swaps de CFD	Garantie en numéraire due au courtier sur options OTC sur swaps de CFD	Contrats à terme ferme dus par le courtier	Contrats à terme ferme dus au courtier	Compartiment	Devise	Garantie en numéraire due par le courtier sur options OTC sur swaps de CFD	Garantie en numéraire due au courtier sur options OTC sur swaps de CFD	Contrats à terme ferme dus par le courtier	Contrats à terme ferme dus au courtier
Asian High Yield Bond Fund	USD	-	(270.712)	4.485.744	(607.307)	Global High Yield Bond Fund	USD	4.550.000	(1.776.752)	99.436	(15.099)
Asian Multi-Asset Income Fund	USD	297.067	-	73.720	-	Global Inflation Linked Bond Fund	USD	407.388	-	418.254	(24.016)
Asian Sustainable Equity Fund	USD	-	-	11	-	Global Multi-Asset Income Fund	USD	641.821	(1.810.000)	34.337.334	(5.866.327)
Asian Tiger Bond Fund	USD	97.809.782	(3.440.000)	1.465.730	(609.615)	Impact Bond Fund ⁽²⁾	EUR	182.736	(9.156)	127.925	(11)
China Bond Fund	CNH	14.144.964	-	45.378.024	-	India Fund	USD	-	-	57	-
China Fund	USD	660.000	-	-	-	Sustainable Asian Bond Fund	USD	1.600.869	(69)	303.635	(63.779)
China Impact Fund	USD	-	-	7	-	Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	USD	267.601	(62.882)	97.216	(25.693)
China Multi-Asset Fund ⁽²⁾	USD	164.000	(46.727)	183.124	(73.055)	Sustainable Emerging Markets Bond Fund	USD	12.002	(590.014)	132.000	(17.726)
China Onshore Bond Fund ⁽²⁾	CNH	-	-	1.534.814	(203.704)	Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	USD	-	(130.000)	44.000	(22.781)
Climate Action Multi-Asset Fund	EUR	-	-	120.932	(30.423)	Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	USD	1.516.283	(1.516.650)	189.000	(77.532)
Continental European Flexible Fund	EUR	1.090.000	-	-	-	Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	EUR	10.666.228	(1.862.904)	5.263.562	(291.132)
Dynamic High Income Fund	USD	-	(1.060.000)	12.465.810	(2.701.449)	Sustainable Global Allocation Fund ⁽²⁾	USD	99.510	-	879.927	(31.791)
Emerging Europe Fund ⁽³⁾	EUR	-	-	4.091.203	(3.331)	Sustainable Global Bond Income Fund	USD	501.299	(19.688)	874.512	(5.502)
Emerging Markets Bond Fund	USD	404.000	(1.961.116)	527.000	(63.174)	Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾	USD	11.750.175	(951.696)	2.461.771	(55.031)
Emerging Markets Corporate Bond Fund	USD	-	(360.000)	508.000	(265.147)	Systematic China A-Share Opportunities Fund	USD	-	-	970.963	(144.514)
Emerging Markets Fund	USD	2.470.000	(2.010.000)	1.676.520	-	Systematic China Environmental Tech Fund ⁽²⁾	USD	-	-	14.000	(2.050)
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	USD	5.358.351	(5.227.089)	637.000	(262.115)	Systematic Global Equity High Income Fund	USD	-	-	259.411.969	(2.285.029)
Emerging Markets Sustainable Equity Fund	USD	-	-	34.570	-	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund ⁽²⁾	USD	-	-	1.027.719	(40.665)
ESG Global Conservative Income Fund	EUR	-	(280.000)	2.356.727	(1.016.405)	Systematic Sustainable Global SmallCap Fund ⁽⁴⁾	USD	-	-	375.000	(76.821)
ESG Global Multi-Asset Income Fund	USD	-	-	835.000	(84.621)	US Dollar Bond Fund	USD	582.609	(327.548)	1.046.919	(29.670)
ESG Multi-Asset Fund	EUR	7.860.000	(7.390.999)	37.716.188	(8.543.608)	US Dollar High Yield Bond Fund	USD	1.677.000	(1.322.390)	206.395	(17.807)
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾	USD	-	-	143.798	(14.462)	US Dollar Short Duration Bond Fund	USD	2.090.000	-	6.605.728	(152.791)
Euro Bond Fund	EUR	4.968.079	(1.301.795)	5.884.968	(414.696)	World Healthscience Fund	USD	4.750.000	-	-	-
Euro Corporate Bond Fund	EUR	15.927.767	(3.288.614)	5.620.549	-	World Real Estate Securities Fund	USD	40.000	-	-	-
Euro Short Duration Bond Fund	EUR	7.938.481	(589.111)	10.577.515	(871.548)						
European High Yield Bond Fund	EUR	884.000	(4.000)	-	-						
Fixed Income Global Opportunities Fund	USD	174.775.919	(33.840.027)	93.824.523	(1.557.903)						
Global Allocation Fund	USD	17.414.768	(6.802.009)	79.097.026	(2.585.918)						
Global Corporate Bond Fund	USD	4.226.498	(1.083.552)	6.083.349	(1.111.675)						
Global Dynamic Equity Fund	USD	-	-	1.592.318	(587.477)						
Global Government Bond Fund	USD	5.176.871	(1.841.383)	5.725.609	(1.245.951)						

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Annexe aux États Financiers suite

15. Dividendes

La politique actuelle des Administrateurs en relation avec le paiement des dividendes dépend de la Catégorie d'Actions. Pour les Catégories d'Actions de non-distribution, la politique actuelle est de conserver et de réinvestir tout le revenu net. À cet égard, les revenus sont conservés dans la VL et reflétés dans la VL par action de la Catégorie concernée. Pour les Catégories d'Actions de distribution, la politique est essentiellement de distribuer la totalité du revenu des investissements (le cas échéant) pour la période après déduction des dépenses pour les Catégories d'Actions qui distribuent un revenu net, ou la totalité du revenu des investissements pour la période et potentiellement une portion du capital avant déduction des dépenses des Catégories d'Actions qui distribuent un revenu brut. Pour de plus amples informations concernant les politiques de distribution de chaque Catégorie d'Actions de distribution, veuillez consulter la section intitulée « Calcul des dividendes ». Les Administrateurs peuvent également déterminer si et dans quelle mesure les dividendes peuvent comprendre les distributions de plus-values réalisées nettes et non réalisées nettes. Certains Compartiments et/ou certaines Catégories d'Actions (par exemple les Actions de distribution (S), les Actions de distribution (R) et les Actions de distribution (Y)) peuvent donner lieu à des distributions du capital et du revenu ainsi que de plus-values nettes réalisées et de plus-values nettes non réalisées. Si des Catégories d'Actions de Distribution versent des dividendes comprenant des plus-values nettes réalisées ou des plus-values nettes non réalisées, ou dans le cas de Compartiments qui distribuent le revenu brut, les dividendes peuvent comprendre le capital initialement souscrit. Si des dividendes sont prélevés sur le capital du Compartiment, cela entraînera une érosion du capital et peut limiter la croissance ultérieure du capital.

Lorsqu'un Compartiment bénéficie du statut de Compartiment déclarant au Royaume-Uni et que ses revenus déclarés dépassent les distributions effectuées, l'excédent sera considéré comme un revenu réputé distribué et sera imposé en tant que revenu, conformément au statut fiscal de l'investisseur.

Pour les Compartiments qui offrent des actions de distribution, la fréquence à laquelle les dividendes sont payés est déterminée par le type de Compartiment. Pour de plus amples informations sur le paiement des dividendes, veuillez consulter le Prospectus.

Vous trouverez dans le Prospectus les options de déclaration, de paiement et de réinvestissement de dividendes offertes aux actionnaires.

16. Facilité de crédit

Une facilité de crédit de 2,150 milliards d'USD organisée par JPMorgan Chase Bank N.A. (« JPMorgan ») permettra à la Société de disposer d'une tranche engagée de 1,225 milliard d'USD. La portion de la facilité de crédit de 1,225 milliard d'USD sera répartie entre les Compartiments, sur la base de l'Avis de répartition daté du 21 avril 2023.

Cette facilité de crédit sera utilisée par les Compartiments à des fins de financement temporaire, y compris, sans s'y restreindre, le financement des rachats demandés par les investisseurs. Les intérêts et les commissions d'engagement en lien avec les montants prélevés sur cette facilité de crédit sont couverts par les actifs des Compartiments concernés. Un nouveau Compartiment ne fera pas automatiquement l'objet

d'une ligne de crédit et devra par conséquent être ajouté au moyen d'un processus d'adhésion. Ce processus comprend, entre autres, tout contrôle préalable nécessaire effectué par les prêteurs, dans le but d'autoriser l'ajout de nouveaux Compartiments. Durant cette période, ces Compartiments ne feront l'objet d'aucune ligne de crédit, ni ne pourront faire de prélèvements sur une quelconque ligne de crédit. De plus, rien ne garantit que l'ajout de nouveaux compartiments sera approuvé par les prêteurs, ni que le crédit sera disponible pour un Compartiment puisque la ligne de crédit est fonction de la disponibilité (sur une base d'allocation équitable) pour les Compartiments et autres fonds BlackRock parties à la convention de crédit. À ce titre, certains Compartiments peuvent ne pas faire l'objet de la ligne de crédit et ne supporteront aucuns frais associés à cette dernière.

Une commission d'engagement de prêt est facturée en relation avec cette facilité de crédit, et est comprise dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif sous le poste « Commissions d'engagement de prêt ». La commission d'engagement de prêt facturée est de 0,10 % de l'encours.

Aucune partie de la facilité de crédit n'a été utilisée au cours de l'exercice clos le 31 août 2023.

17. Coûts de transaction

Pour atteindre son objectif d'investissement, un Compartiment engagera des coûts de transaction en lien avec l'activité de négociation dans son portefeuille. Dans le tableau ci-dessous, sont identifiables séparément les coûts de transaction engagés par chaque Compartiment pour l'exercice clos le 31 août 2023. Ceci comprend les frais de commission, les frais de règlement et les frais de courtier.

Compartiment	Devise	Coûts de transaction
Asia Pacific Equity Income Fund ⁽¹⁾	USD	208.710
Asian Dragon Fund	USD	1.205.225
Asian Growth Leaders Fund	USD	1.758.292
Asian High Yield Bond Fund	USD	30.588
Asian Multi-Asset Income Fund	USD	197.501
Asian Sustainable Equity Fund	USD	8.984
Asian Tiger Bond Fund	USD	20.225
Brown To Green Materials Fund ⁽²⁾	USD	13.586
China Bond Fund	CNH	1.986.242
China Flexible Equity Fund	USD	33.451
China Fund	USD	5.214.356
China Impact Fund	USD	61.046
China Innovation Fund	USD	50.302
China Multi-Asset Fund ⁽²⁾	USD	10.061
China Onshore Bond Fund ⁽²⁾	CNH	46.771
Circular Economy Fund	USD	1.664.641
Climate Action Equity Fund	USD	5.085
Climate Action Multi-Asset Fund	EUR	125.652
Continental European Flexible Fund	EUR	4.455.902
Developed Markets Sustainable Equity Fund	USD	19.954
Dynamic High Income Fund	USD	860.569
Emerging Europe Fund ⁽³⁾	EUR	535.763
Emerging Markets Bond Fund	USD	4.593
Emerging Markets Corporate Bond Fund	USD	5.971
Emerging Markets Equity Income Fund	USD	682.586
Emerging Markets Fund	USD	5.698.631
Emerging Markets Impact Bond Fund	USD	2.086
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	USD	9.629
Emerging Markets Sustainable Equity Fund	USD	119.983
ESG Flex Choice Cautious Fund	USD	21.026
ESG Flex Choice Growth Fund	USD	15.496

Annexe aux États Financiers suite

Compartiment	Devise	Coûts de transaction
ESG Flex Choice Moderate Fund	USD	3.564
ESG Global Conservative Income Fund	EUR	116.709
ESG Global Multi-Asset Income Fund	USD	146.613
ESG Multi-Asset Fund	EUR	3.041.590
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾	USD	24.292
Euro Bond Fund	EUR	19.123
Euro Corporate Bond Fund	EUR	11.640
Euro Reserve Fund	EUR	4.107
Euro Short Duration Bond Fund	EUR	14.348
Euro-Markets Fund	EUR	1.314.489
European Equity Income Fund	EUR	3.485.465
European Focus Fund	EUR	510.470
European Fund	EUR	2.030.046
European High Yield Bond Fund	EUR	8.686
European Special Situations Fund	EUR	2.085.261
European Sustainable Equity Fund	EUR	4.456
European Value Fund	EUR	1.511.180
FinTech Fund	USD	256.267
Fixed Income Global Opportunities Fund	USD	263.654
Future Consumer Fund	USD	11.239
Future Of Transport Fund	USD	1.532.002
Global Allocation Fund	USD	6.395.462
Global Corporate Bond Fund	USD	19.288
Global Dynamic Equity Fund	USD	339.476
Global Equity Income Fund	USD	433.890
Global Government Bond Fund	USD	20.225
Global High Yield Bond Fund	USD	50.325
Global Inflation Linked Bond Fund	USD	9.086
Global Long-Horizon Equity Fund	USD	507.420
Global Multi-Asset Income Fund	USD	1.956.978
Impact Bond Fund ⁽²⁾	EUR	4.258
India Fund	USD	868.195
Japan Flexible Equity Fund	JPY	15.110.918
Japan Small & MidCap Opportunities Fund	JPY	13.182.064
Latin American Fund	USD	1.086.034
Multi-Theme Equity Fund	USD	10.208
Natural Resources Fund ⁽⁷⁾	USD	398.339
Next Generation Health Care Fund	USD	12.902
Next Generation Technology Fund	USD	2.751.527
Nutrition Fund	USD	349.698
Sustainable Asian Bond Fund	USD	2.498
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	USD	5.011
Sustainable Emerging Markets Bond Fund	USD	5.692
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	USD	3.082
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	USD	8.008
Sustainable Energy Fund	USD	3.355.471
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	EUR	64.012
Sustainable Global Allocation Fund ⁽²⁾	USD	55.808
Sustainable Global Bond Income Fund	USD	10.886
Sustainable Global Infrastructure Fund	USD	23.891
Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾	USD	48.594
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund ⁽⁵⁾	CHF	194.118
Systematic China A-Share Opportunities Fund	USD	2.379.176
Systematic China Environmental Tech Fund ⁽²⁾	USD	22.823
Systematic Global Equity High Income Fund	USD	2.416.315
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund ⁽²⁾	USD	37.470
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund ⁽⁴⁾	USD	644.487
United Kingdom Fund	GBP	589.933
US Basic Value Fund	USD	482.962

Compartiment	Devise	Coûts de transaction
US Dollar Bond Fund	USD	67.703
US Dollar High Yield Bond Fund	USD	51.714
US Dollar Reserve Fund	USD	8.038
US Dollar Short Duration Bond Fund	USD	18.255
US Flexible Equity Fund	USD	631.111
US Government Mortgage Impact Fund	USD	31.892
US Growth Fund	USD	54.518
US Mid-Cap Value Fund	USD	279.791
US Sustainable Equity Fund	USD	1.440
World Energy Fund	USD	1.961.849
World Financials Fund	USD	1.939.888
World Gold Fund	USD	2.217.316
World Healthscience Fund	USD	2.365.932
World Mining Fund	USD	1.315.296
World Real Estate Securities Fund	USD	194.050
World Technology Fund	USD	3.863.211

⁽¹⁾ Compartiment dissous au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Tous les coûts de transaction ne sont pas identifiables séparément. Pour les investissements à revenu fixe, les contrats à terme sur devises de gré à gré et autres contrats sur instruments dérivés, les coûts de transaction seront compris dans le prix d'achat et de vente de l'investissement. Bien qu'ils ne soient pas identifiables séparément, ces coûts de transaction seront pris en compte dans la performance de chaque Compartiment. Les coûts d'impact sur le marché ne sont pas identifiables séparément et par conséquent ne figurent pas dans le tableau ci-dessus.

18. Revenus issus de souscription secondaire

La Société peut, avec le consentement du Dépositaire, conclure des accords de souscription secondaire. Les accords de souscription secondaire permettent à la Société de soutenir une émission de droits, avant l'investissement par d'autres souscripteurs, en contrepartie d'une commission. Au cours de l'exercice, aucun Compartiment n'a perçu de revenu issu d'accords de souscription secondaire.

19. Événements ultérieurs

Avec effet le 28 septembre 2023, le Compartiment Swiss Small & MidCap Opportunities Fund a été rouvert aux souscriptions.

Avec effet le 26 octobre 2023, une mise à jour du Prospectus de la Société a été publiée.

À compter du 26 octobre 2023, le Compartiment Natural Resources Growth & Income Fund a changé de dénomination pour devenir Natural Resources Fund.

Avec effet le 7 novembre 2023, le Compartiment China Flexible Equity Fund a été liquidé.

Rapport du Réviseur d'entreprises

À l'attention des Actionnaires de
BlackRock Global Funds
2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg

Opinion

Nous avons contrôlé les états financiers de BlackRock Global Funds (le «Fonds») et de chacun de ses compartiments, à savoir le bilan, le portefeuille d'investissements au 31 août 2023, le compte de résultat et l'évolution de l'actif net pour l'exercice clos à cette date, ainsi que l'annexe aux états financiers, y compris un résumé des principales règles comptables.

À notre avis, les présents états financiers donnent une image fidèle de la situation financière du Fonds et de chacun de ses compartiments au 31 août 2023 ainsi que des résultats de leurs opérations et des changements apportés à leur actif net pour l'exercice clos à cette date en conformité avec les prescriptions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg en matière de préparation et de présentation des états financiers.

Fondement de l'opinion

Nous avons mené notre audit conformément à la loi du 23 juillet 2016 relative à la profession de l'audit (la «Loi du 23 juillet 2016») et aux Normes de révision internationales (International Standards on Auditing ou ISA) telles qu'elles ont été adoptées pour le Luxembourg par la Commission de surveillance du secteur financier («CSSF»). Nos responsabilités en vertu de la Loi du 23 juillet 2016 et des ISA, telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, sont décrites de façon plus détaillée dans la section de notre rapport intitulée «Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé s'agissant de l'audit des états financiers». Nous sommes également indépendants du Fonds conformément au Code d'éthique publié à l'intention des comptables professionnels par le Conseil des normes internationales de déontologie comptable («Code IESBA») tel qu'adopté pour le Luxembourg par la CSSF, ainsi qu'aux exigences éthiques concernant notre audit des états financiers, et nous nous sommes acquittés de nos responsabilités éthiques en vertu de ces normes de déontologie. Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus constituent une base raisonnable pour exprimer notre opinion.

Éléments préoccupants

Nous attirons votre attention sur le point des états financiers qui indique que les souscriptions, rachats et conversions de toutes les catégories d'actions et la détermination des valeurs liquidatives de BlackRock Global Funds – Emerging Europe Fund (le «Compartiment») ont été temporairement suspendus avec effet à compter du 1er mars 2022 et jusqu'à nouvel ordre, en raison des conditions de négociation actuelles liées à l'exposition d'investissement importante du Compartiment à la Russie, faisant suite à l'invasion de l'Ukraine par la Russie. Au 31 août 2023, le Conseil d'administration n'a pas l'intention de fermer le Compartiment et les états financiers ont donc été préparés sur une base de continuité des activités. Notre opinion n'est pas modifiée à cet égard.

Informations complémentaires

Le Conseil d'administration du Fonds est responsable des autres informations. Les informations complémentaires comprennent les informations contenues dans le rapport annuel mais ne comprennent pas les états financiers ni notre rapport de réviseur d'entreprises sur ces derniers.

Notre opinion sur les états financiers ne couvre pas les informations complémentaires et nous n'exprimons aucune forme de conclusion assortie d'une assurance sur lesdites informations complémentaires.

En ce qui concerne notre audit des états financiers, il est de notre responsabilité de lire les informations complémentaires et, ce faisant, de considérer si ces informations complémentaires présentent une incompatibilité de fond avec les états financiers ou si les informations dont nous avons pris connaissance lors de l'audit semblent de toute autre façon comporter des inexactitudes importantes. Si, sur la base de notre travail, nous concluons que ces informations complémentaires comportent des inexactitudes importantes, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

Responsabilité du Conseil d'administration du Fonds concernant les états financiers

Le Conseil d'administration du Fonds est responsable de la préparation et de la présentation fidèle de ces états financiers, en conformité avec les prescriptions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg en matière de préparation et de présentation des états financiers, et de tout contrôle interne que le Conseil d'administration du Fonds jugera nécessaire à la préparation d'états financiers exempts d'anomalies importantes dues à une fraude ou à une erreur.

Dans le cadre de la préparation des états financiers, le Conseil d'administration du Fonds est chargé d'évaluer la capacité du Fonds et de chacun de ses compartiments à poursuivre leurs activités, d'indiquer, selon le cas, les questions liées à la poursuite des activités, et d'utiliser le principe comptable de continuité des activités, à moins que le Conseil d'administration du Fonds ait l'intention de liquider le Fonds ou l'un de ses compartiments ou de cesser ses opérations, ou qu'il n'ait aucune autre solution réaliste.

Responsabilités du réviseur d'entreprises agréé s'agissant de l'audit des états financiers

Nos objectifs sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies importantes, dues à une fraude ou à une erreur, et de publier un rapport du réviseur d'entreprises agréé comprenant notre opinion. L'assurance raisonnable est un niveau d'assurance élevé, mais n'est pas une garantie selon laquelle un audit mené conformément aux dispositions de la loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF détectera toujours toute anomalie importante existante. Les anomalies peuvent découler d'une fraude ou d'une erreur, et sont réputées importantes si, individuellement ou collectivement, elles sont raisonnablement susceptibles d'influencer les décisions économiques des utilisateurs prises sur la base de ces états financiers.

Dans le cadre d'un audit conformément à la loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous exerçons un jugement professionnel et adoptons une attitude de scepticisme professionnel tout au long de l'audit. En outre, nous :

- identifions et évaluons les risques d'anomalie importante dans les états financiers, due à une fraude ou à une erreur, nous établissons et réalisons des procédures d'audit adaptées à ces risques, et nous obtenons les éléments probants qui constituent une base raisonnable pour exprimer notre opinion. Le risque de ne pas détecter une anomalie importante due à une fraude est plus élevé que lorsque celle-ci est due à une erreur, puisqu'une fraude peut comporter une collusion, une contrefaçon, des omissions intentionnelles, de fausses déclarations ou la dérogation à un contrôle interne.
- veillons à bien comprendre le contrôle interne concernant l'audit, afin d'établir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne du Fonds.
- évaluons le caractère approprié des politiques comptables utilisées ainsi que le caractère raisonnable des estimations comptables et informations connexes émanant du Conseil d'administration.
- formulons des conclusions sur le caractère approprié de l'utilisation par le Conseil d'administration du Fonds du principe comptable de continuité des activités et, sur la base des éléments probants obtenus, sur la présence ou non d'une incertitude importante quant aux événements ou conditions pouvant jeter un doute significatif sur la capacité du Fonds ou de l'un de ses compartiments à poursuivre ses activités. Si nous concluons à l'existence d'incertitudes importantes, nous sommes tenus, dans notre rapport du réviseur d'entreprises agréé, d'attirer l'attention sur les informations connexes figurant dans les états financiers ou, si ces informations sont inappropriées, de modifier notre opinion. Nos conclusions sont fondées sur les éléments probants obtenus au jour de notre rapport du réviseur d'entreprises agréé. Toutefois, des événements ou conditions à venir peuvent conduire le Fonds ou l'un quelconque de ses compartiments (à l'exception des compartiments pour lesquels une liquidation a été décidée ou est envisagée) à cesser ses activités.
- s'agissant des compartiments pour lesquels une fermeture a été décidée ou est envisagée, nous estimons qu'une utilisation par le Conseil d'administration du principe comptable de non-continuité des activités est appropriée. Nous évaluons également l'adéquation des informations décrivant le principe comptable de non-continuité des activités et les raisons de son utilisation. Nos conclusions sont fondées sur les éléments probants obtenus au jour de notre rapport du réviseur d'entreprises agréé.
- évaluons la présentation générale, la structure et le contenu des états financiers, y compris les informations y figurant, et vérifions si les états financiers représentent les transactions et événements sous-jacents de manière à réaliser une présentation fidèle.

Nous communiquons avec les personnes chargées de la gouvernance en ce qui concerne, entre autres choses, l'étendue et le calendrier de l'audit ainsi que les principales conclusions de ce dernier, y compris les lacunes importantes du contrôle interne que nous identifions au cours de l'audit.

Nous fournissons également, aux personnes chargées de la gouvernance, une déclaration selon laquelle nous avons rempli les exigences éthiques concernées en matière d'indépendance, et les informons de toutes les relations ou autres questions dont on pourrait raisonnablement penser qu'elles agissent sur notre indépendance et, le cas échéant, les actions entreprises pour éliminer les menaces ou les garanties appliquées.

Ernst & Young
Société anonyme
Cabinet de révision agréé

Kerry Nichol

Luxembourg, le 29 novembre 2023

Appendice I – Catégories d'actions (non révisé)

Catégories d'actions lancées et réactivées

La Date d'effet indiquée ci-dessous correspond à la date à laquelle les actions ont été émises dans la catégorie concernée du Fonds pour la première fois. Les catégories peuvent avoir été ouvertes à la souscription à une date antérieure.

Date d'effet	Compartiment	Type
6 septembre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni - CNH
6 septembre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - CNH
6 septembre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - CNH
6 septembre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - CNH
6 septembre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD
7 septembre 2022	Emerging Markets Corporate Bond Fund	Action de Catégorie SR de distribution (M) - USD
7 septembre 2022	World Real Estate Securities Fund	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) - USD
14 septembre 2022	Sustainable Global Bond Income Fund	Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR
21 septembre 2022	Natural Resources Fund	Action de Catégorie S de distribution (Q) (G)- EUR
21 septembre 2022	Natural Resources Fund	Action de Catégorie S de distribution (Q) (G)- USD
21 septembre 2022	Natural Resources Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
21 septembre 2022	Natural Resources Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - USD
21 septembre 2022	World Mining Fund	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni - GBP
21 septembre 2022	World Mining Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - GBP
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
22 septembre 2022	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR

Appendice I – Catégories d'actions (non révisé) suite

Date d'effet	Compartiment	Type
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
4 octobre 2022	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
6 octobre 2022	Impact Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 octobre 2022	Impact Bond Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 octobre 2022	Impact Bond Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 octobre 2022	Impact Bond Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 octobre 2022	Impact Bond Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD
6 octobre 2022	Impact Bond Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 octobre 2022	Impact Bond Fund	Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
12 octobre 2022	Emerging Markets Impact Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
12 octobre 2022	Global Equity Income Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
12 octobre 2022	Sustainable Asian Bond Fund	Action de Catégorie ZI de distribution (S) (M) (G) - USD
12 octobre 2022	Sustainable Asian Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
12 octobre 2022	Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
12 octobre 2022	Sustainable Emerging Markets Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
12 octobre 2022	Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
12 octobre 2022	Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
12 octobre 2022	Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - EUR
12 octobre 2022	Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en USD
19 octobre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie ZI de distribution (R) (M) (G) couverte en USD
19 octobre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - CNH
19 octobre 2022	Sustainable Energy Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
19 octobre 2022	Sustainable Global Bond Income Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
19 octobre 2022	Sustainable Global Bond Income Fund	Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR
19 octobre 2022	US Government Mortgage Impact Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
19 octobre 2022	US Government Mortgage Impact Fund	Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR
19 octobre 2022	World Energy Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
19 octobre 2022	World Financials Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
19 octobre 2022	World Gold Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	China Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	Future Of Transport Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	Global Equity Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	Next Generation Technology Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	US Basic Value Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	World Healthscience Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	World Mining Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	World Real Estate Securities Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
26 octobre 2022	World Technology Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
23 novembre 2022	China Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD

Appendice I – Catégories d'actions (non révisé) suite

Date d'effet	Compartiment	Type
23 novembre 2022	China Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD
23 novembre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD
23 novembre 2022	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD
23 novembre 2022	Emerging Markets Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie X - CAD
23 novembre 2022	Global High Yield Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie X - CAD
4 janvier 2023	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) - USD
18 janvier 2023	Emerging Markets Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie X - CAD
18 janvier 2023	World Real Estate Securities Fund	Action de capitalisation de Catégorie X - CAD
1 ^{er} février 2023	Asian Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - EUR
1 ^{er} février 2023	Asian Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
1 ^{er} février 2023	Developed Markets Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - EUR
1 ^{er} février 2023	Developed Markets Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
1 ^{er} février 2023	Emerging Markets Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - EUR
1 ^{er} février 2023	Emerging Markets Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
1 ^{er} février 2023	European Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - EUR
1 ^{er} février 2023	European Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
1 ^{er} février 2023	US Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - EUR
1 ^{er} février 2023	US Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
15 février 2023	Impact Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie E - EUR
15 février 2023	Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR
8 mars 2023	China Onshore Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie E - EUR
8 mars 2023	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR
8 mars 2023	China Onshore Bond Fund	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR
8 mars 2023	European Equity Income Fund	Action de Catégorie D de distribution (M) (G) - SGD
8 mars 2023	European Equity Income Fund	Action de Catégorie D de distribution (M) (G) - USD
22 mars 2023	Sustainable Emerging Markets Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie I couverte en NOK
5 avril 2023	Circular Economy Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
5 avril 2023	Circular Economy Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD
5 avril 2023	Circular Economy Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH
5 avril 2023	Circular Economy Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD
26 avril 2023	Natural Resources Fund	Action de Catégorie S de distribution (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni - GBP
26 avril 2023	Natural Resources Fund	Action de Catégorie S de distribution (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
26 avril 2023	Natural Resources Fund	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - GBP
26 avril 2023	Natural Resources Fund	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
17 mai 2023	Global Long-Horizon Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie X - AUD
24 mai 2023	Global Long-Horizon Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie I - USD
24 mai 2023	Sustainable Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK
31 mai 2023	World Real Estate Securities Fund	Action de Catégorie X de distribution (Q) - AUD
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de capitalisation de Catégorie A - EUR
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de capitalisation de Catégorie A - USD
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de capitalisation de Catégorie AI - EUR
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - EUR
6 juin 2023	Brown To Green Materials Fund	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD

Appendice I – Catégories d'actions (non révisé) suite

Date d'effet	Compartiment	Type
7 juin 2023	Fixed Income Global Opportunities Fund	Action de Catégorie A de distribution (M) (G) - USD
7 juin 2023	Global Corporate Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (M) (G) - USD
7 juin 2023	Sustainable Global Bond Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (M) (G) - USD
7 juin 2023	US Dollar Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (M) (G) - USD
14 juin 2023	World Financials Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - USD
14 juin 2023	World Financials Fund	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR
15 juin 2023	Systematic China Environmental Tech Fund	Action de capitalisation de Catégorie A - CNH
15 juin 2023	Systematic China Environmental Tech Fund	Action de capitalisation de Catégorie A - USD
15 juin 2023	Systematic China Environmental Tech Fund	Action de capitalisation de Catégorie D - USD
15 juin 2023	Systematic China Environmental Tech Fund	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR
15 juin 2023	Systematic China Environmental Tech Fund	Action de capitalisation de Catégorie I - USD
15 juin 2023	Systematic China Environmental Tech Fund	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
15 juin 2023	Systematic China Environmental Tech Fund	Action de capitalisation de Catégorie Z - USD
15 juin 2023	Systematic China Environmental Tech Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI - USD
21 juin 2023	Euro Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
21 juin 2023	Euro Short Duration Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
21 juin 2023	Global Allocation Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
21 juin 2023	Global Allocation Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - USD
21 juin 2023	Global Allocation Fund	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR
28 juin 2023	China Bond Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD
28 juin 2023	China Bond Fund	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD
28 juin 2023	Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie S de distribution (A) - EUR
28 juin 2023	Sustainable Energy Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
28 juin 2023	US Dollar Short Duration Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
28 juin 2023	US Dollar Short Duration Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - USD
28 juin 2023	US Dollar Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR
28 juin 2023	World Healthscience Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
28 juin 2023	World Healthscience Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - USD
28 juin 2023	World Healthscience Fund	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR
5 juillet 2023	China Bond Fund	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR
5 juillet 2023	China Bond Fund	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en USD
5 juillet 2023	Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Action de distribution (M) de Catégorie S - EUR
5 juillet 2023	Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
5 juillet 2023	Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - USD
5 juillet 2023	Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR
5 juillet 2023	World Energy Fund	Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni - USD
12 juillet 2023	Euro Bond Fund	Action de distribution (M) de Catégorie S - EUR
12 juillet 2023	Euro Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - USD
12 juillet 2023	Euro Short Duration Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - USD
13 juillet 2023	China Multi-Asset Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
13 juillet 2023	China Multi-Asset Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH
13 juillet 2023	China Multi-Asset Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD
13 juillet 2023	China Multi-Asset Fund	Action de capitalisation de Catégorie A - USD
13 juillet 2023	China Multi-Asset Fund	Action de capitalisation de Catégorie I - USD
13 juillet 2023	China Multi-Asset Fund	Action de capitalisation de Catégorie X - USD
19 juillet 2023	Euro Short Duration Bond Fund	Action de distribution (M) de Catégorie S - EUR
19 juillet 2023	Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en USD
19 juillet 2023	Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) - USD
19 juillet 2023	Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD
19 juillet 2023	Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH
19 juillet 2023	Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en EUR
19 juillet 2023	Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD
19 juillet 2023	Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en SGD
19 juillet 2023	Global Allocation Fund	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en ZAR
19 juillet 2023	Sustainable Energy Fund	Action de Catégorie S de distribution (A) - EUR
19 juillet 2023	US Dollar Short Duration Bond Fund	Action de distribution (M) de Catégorie S - USD
19 juillet 2023	US Flexible Equity Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CZK
19 juillet 2023	World Financials Fund	Action de capitalisation de Catégorie S - EUR
26 juillet 2023	Circular Economy Fund	Action de capitalisation de Catégorie C - EUR

Appendice I – Catégories d'actions (non révisé) suite

Date d'effet	Compartiment	Type
26 juillet 2023	Emerging Markets Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie X - GBP
26 juillet 2023	Future Of Transport Fund	Action de capitalisation de Catégorie C - EUR
26 juillet 2023	Next Generation Technology Fund	Action de capitalisation de Catégorie C - EUR
26 juillet 2023	US Dollar Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CNH
26 juillet 2023	US Flexible Equity Fund	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP
2 août 2023	Asian Tiger Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH
2 août 2023	Systematic Global Equity High Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR
9 août 2023	Asian Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD
9 août 2023	Asian Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD
9 août 2023	Asian Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH
9 août 2023	Asian Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR
9 août 2023	Asian Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP
9 août 2023	Asian Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en JPY

Catégories d'actions émises

Au 31 août 2023, la Société offrait les catégories d'actions suivantes. Pour les Compartiments ayant plus d'une Devise de Négociation, les cours des Devises de Négociation supplémentaires sont déterminés par la conversion du cours au taux de change au comptant concerné au moment de l'évaluation.

Catégorie A

Action de Catégorie A de distribution (A) (G)
 Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en CHF
 Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR
 Action de distribution (A) de Catégorie A
 Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni
 Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
 Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD
 Action de distribution (D) de Catégorie A
 Action de Catégorie A de distribution (D) couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (D) de fonds déclarant au Royaume-Uni
 Action de Catégorie A de distribution (D) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (M) (G)
 Action de distribution (M) de Catégorie A
 Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD
 Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CAD
 Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CNH
 Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP
 Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en HKD
 Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD
 Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en SGD
 Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)
 Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en AUD
 Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD
 Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en USD
 Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni
 Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF
 Action de distribution (Q) de Catégorie A
 Action de Catégorie A de distribution (Q) couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (Q) couverte en SGD
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD

Catégorie A suite

Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en GBP
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en SGD
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR
 Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en JPY
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en USD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en AUD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CAD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en NZD
 Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD
 Action de Catégorie A de distribution (T)
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en EUR
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en SGD
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en USD
 Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en ZAR
 Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G)
 Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G) couverte en AUD
 Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G) couverte en SGD

Appendice I – Catégories d’actions (non révisé) suite

Catégorie X* suite

Action de Catégorie X de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)
Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR
Action de Catégorie X de distribution (T)
Action de capitalisation de Catégorie X
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CAD
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en DKK
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD

Catégorie Z

Action de capitalisation de Catégorie Z
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR
Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en USD
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF

Catégorie ZI

Action de Catégorie ZI de distribution (R) (M) (G) couverte en USD
Action de Catégorie ZI de distribution (S) (M) (G)
Action de capitalisation de Catégorie ZI
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en USD
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni
Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR

* Disponible pour les investisseurs institutionnels.

Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)

Exposition globale

Conformément à la politique actuelle de BlackRock, l'exposition globale est mesurée selon l'« approche par les engagements » ou l'approche de la valeur à risque (« VaR »), et couvre l'ensemble des composantes du portefeuille.

L'approche par les engagements est une méthode qui regroupe les valeurs de marché sous-jacentes ou les valeurs notionnelles des instruments financiers dérivés afin de déterminer le degré d'exposition globale d'un Compartiment aux instruments financiers dérivés.

Conformément à la Loi de 2010, l'exposition globale d'un Compartiment selon la méthode par les engagements ne doit pas excéder 100 % de la Valeur Liquidative de ce Compartiment.

Voici la liste des Compartiments qui utilisent l'approche par les engagements :

- ▶ Asian Dragon Fund
- ▶ Asian Growth Leaders Fund
- ▶ Asian Sustainable Equity Fund
- ▶ Brown To Green Materials Fund⁽²⁾
- ▶ China Flexible Equity Fund
- ▶ China Fund
- ▶ China Impact Fund
- ▶ China Innovation Fund
- ▶ China Multi-Asset Fund⁽²⁾
- ▶ Circular Economy Fund
- ▶ Climate Action Equity Fund
- ▶ Continental European Flexible Fund
- ▶ Developed Markets Sustainable Equity Fund
- ▶ Emerging Europe Fund⁽³⁾
- ▶ Emerging Markets Equity Income Fund
- ▶ Emerging Markets Fund
- ▶ Emerging Markets Sustainable Equity Fund
- ▶ ESG Flex Choice Cautious Fund
- ▶ ESG Flex Choice Growth Fund
- ▶ ESG Flex Choice Moderate Fund
- ▶ Euro Reserve Fund
- ▶ Euro-Markets Fund
- ▶ European Equity Income Fund
- ▶ European Focus Fund
- ▶ European Fund
- ▶ European Special Situations Fund
- ▶ European Sustainable Equity Fund
- ▶ European Value Fund
- ▶ FinTech Fund
- ▶ Future Consumer Fund
- ▶ Future Of Transport Fund
- ▶ Global Equity Income Fund
- ▶ Global Long-Horizon Equity Fund
- ▶ India Fund
- ▶ Japan Flexible Equity Fund
- ▶ Japan Small & MidCap Opportunities Fund
- ▶ Latin American Fund
- ▶ Multi-Theme Equity Fund
- ▶ Natural Resources Fund⁽⁷⁾
- ▶ Next Generation Health Care Fund
- ▶ Next Generation Technology Fund
- ▶ Nutrition Fund
- ▶ Sustainable Energy Fund
- ▶ Sustainable Global Infrastructure Fund
- ▶ Swiss Small & MidCap Opportunities Fund⁽⁵⁾
- ▶ Systematic China A-Share Opportunities Fund
- ▶ Systematic China Environmental Tech Fund⁽²⁾
- ▶ Systematic Global Equity High Income Fund
- ▶ Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund⁽²⁾
- ▶ Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾
- ▶ United Kingdom Fund
- ▶ US Basic Value Fund
- ▶ US Dollar Reserve Fund
- ▶ US Flexible Equity Fund
- ▶ US Growth Fund
- ▶ US Mid-Cap Value Fund
- ▶ US Sustainable Equity Fund
- ▶ World Energy Fund
- ▶ World Financials Fund
- ▶ World Gold Fund
- ▶ World Healthscience Fund
- ▶ World Mining Fund
- ▶ World Real Estate Securities Fund
- ▶ World Technology Fund

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)

suite

La VaR est une mesure de risque statistique qui estime la perte potentielle due aux mouvements défavorables du marché, dans un environnement de marché normal.

Les calculs de la VaR sont fondés sur un modèle de simulation historique ajustée dont l'indice de confiance est de 99 %, une période de détention d'un jour et une période d'observation historique d'au moins un an (250 jours). Un chiffre de VaR est défini dans la perspective d'une probabilité spécifique et d'un horizon temporel spécifique. Une VaR à 99 % à un jour signifie que l'on prévoit que pendant 99 % du temps sur une période d'un jour, le Compartiment ne perdra pas plus que ce chiffre en pourcentage. Par conséquent, les VaR élevées indiquent un risque élevé.

Le modèle de VaR utilisé par le service BlackRock chargé de l'analyse des risques et de l'analyse quantitative (« RQA ») est un modèle de simulation historique ajusté.

Pour les Compartiments qui utilisent l'approche VaR relative, le RQA détermine un portefeuille de référence comme base pour le calcul de la VaR relative. Le portefeuille de référence est habituellement l'indice de référence établi lui aussi comme point de référence pour les données de performance du Compartiment concerné. Il s'agit d'un indice (ou d'indices composites) construit(s), par un ou plusieurs fournisseurs d'indice reconnus, à partir de titres dans lesquels les Compartiments peuvent investir. Ce processus prend dûment en compte de la disponibilité d'indices dont les règles de construction sont elles-mêmes conformes aux règles de diversification.

Lorsqu'un Compartiment est contrôlé à l'aide de la VaR, le Gestionnaire Financier par délégation observera la limite réglementaire et toute limite de risque interne éventuellement appropriée pour le portefeuille.

Le tableau ci-dessous présente l'utilisation la plus élevée, l'utilisation la plus faible et l'utilisation moyenne de la limite de VaR, exprimées en pourcentage de la limite réglementaire de la VaR absolue ou relative. En ce qui concerne la VaR relative, la VaR du portefeuille du Compartiment concerné n'excédera pas le double de la VaR du portefeuille de référence. L'utilisation correspond au niveau de risque pris dans ce contexte.

Compartiment	Approche de risque de marché	Portefeuille de référence	Utilisation la plus élevée de la limite de VaR (%)	Utilisation la plus faible de la limite de VaR (%)	Utilisation moyenne de la limite de VaR (%)
Asian High Yield Bond Fund	VaR relative	ICE BofAML Blended Index: ACCY, 20 % Lvl4 Cap 3 % Constrained Index	57,55 %	38,43 %	47,75 %
Asian Multi-Asset Income Fund	VaR relative	50 % MSCI Asia ex Japan Index / 25 % JP Morgan Asia Credit Index / 25 % Markit iBoxx ALBI Index	47,34 %	37,87 %	42,55 %
Asian Tiger Bond Fund	VaR relative	JP Morgan Asian Credit Index	64,91 %	47,25 %	53,51 %
China Bond Fund	VaR absolue	n/a	28,86 %	11,41 %	17,26 %
China Onshore Bond Fund ⁽²⁾	VaR absolue	n/a	26,61 %	14,47 %	19,20 %
Climate Action Multi-Asset Fund	VaR relative	MSCI All Country World Index (Hedged to EUR) 65 % / Bloomberg Global Aggregate Bond Index (Hedged to EUR) 35 %	52,17 %	45,08 %	48,02 %
Dynamic High Income Fund	VaR relative	70 % MSCI World Index / 30 % Bloomberg Global Aggregate Bond Index USD Hedged	51,67 %	34,23 %	43,01 %
Emerging Markets Bond Fund	VaR relative	JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified Index	64,25 %	50,04 %	57,29 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	VaR relative	JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Broad Diversified	61,21 %	48,64 %	54,94 %
Emerging Markets Impact Bond Fund	VaR absolue	n/a	23,94 %	13,65 %	18,48 %
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	VaR relative	JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index	68,45 %	51,04 %	58,30 %
ESG Global Conservative Income Fund	VaR relative	30 % MSCI World Index EUR Hedged / 70 % Bloomberg Global Aggregate Bond Index EUR Hedged	60,25 %	28,75 %	46,00 %
ESG Global Multi-Asset Income Fund	VaR relative	50 % MSCI World Index / 50 % Bloomberg Global Aggregate Bond Index USD Hedged	48,20 %	26,45 %	37,71 %
ESG Multi-Asset Fund	VaR relative	50 % MSCI World Index / 50 % FTSE World Government Bond Euro Hedged Index	57,84 %	41,35 %	48,17 %

Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)

suite

Compartiment	Approche de risque de marché	Portefeuille de référence	Utilisation la plus élevée de la limite de VaR (%)	Utilisation la plus faible de la limite de VaR (%)	Utilisation moyenne de la limite de VaR (%)
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾	VaR relative	1/3 Bloomberg Global Aggregate Corporate USD Hedged Index, 1/3 Bloomberg Global High Yield Index Excl CMBS & EMG 2% Capped USD Hedged Index and 1/3 J.P. Morgan EMBI ESG Global Diversified USD Hedged Index	53,82 %	51,00 %	52,32 %
Euro Bond Fund	VaR relative	Bloomberg Euro-Aggregate 500mm+ Bond Index	54,44 %	49,42 %	51,41 %
Euro Corporate Bond Fund	VaR relative	ICE BofAML Euro Corporate Index	58,65 %	48,44 %	53,68 %
Euro Short Duration Bond Fund	VaR absolue	n/a	12,97 %	8,05 %	10,09 %
European High Yield Bond Fund	VaR relative	Bloomberg Pan European High Yield Ex Financials 3% Capped Index	59,10 %	47,08 %	52,38 %
Fixed Income Global Opportunities Fund	VaR absolue	n/a	16,55 %	10,29 %	13,30 %
Global Allocation Fund	VaR relative	36% S&P 500 Index, 24% FTSE World Index (Ex-US), 24% ICE BofAML Current 5Yr US Treasury Index, 16% FTSE Non-USD World Government Bond	57,30 %	46,17 %	51,68 %
Global Corporate Bond Fund	VaR relative	Bloomberg Global Aggregate Corporate Bond USD Hedged Index	54,69 %	48,94 %	51,74 %
Global Dynamic Equity Fund	VaR relative	60% S&P 500 Index, 40% FTSE World (ex US) Index	55,40 %	51,41 %	53,31 %
Global Government Bond Fund	VaR relative	FTSE World Government Bond USD Hedged Index	59,74 %	48,27 %	53,44 %
Global High Yield Bond Fund	VaR relative	BofA Merrill Lynch Global High Yield Constrained USD Hedged Index	51,27 %	45,42 %	47,94 %
Global Inflation Linked Bond Fund	VaR relative	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index	58,13 %	46,04 %	51,29 %
Global Multi-Asset Income Fund	VaR relative	50% MSCI World Index/50% Bloomberg Global Aggregate Bond Index USD Hedged	41,96 %	29,91 %	35,55 %
Impact Bond Fund ⁽²⁾	VaR relative	ICE Green, Social & Sustainable Bond Index, EUR Hedged	53,41 %	48,48 %	51,26 %
Sustainable Asian Bond Fund	VaR relative	JP Morgan ESG Asia Credit Index	52,96 %	39,77 %	47,79 %
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	VaR absolue	n/a	42,06 %	27,74 %	35,00 %
Sustainable Emerging Markets Bond Fund	VaR relative	JP Morgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified Index	63,57 %	47,72 %	53,98 %
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	VaR relative	JP Morgan ESG Corporate Emerging Markets Bond Index Broad Diversified Index	59,95 %	47,34 %	53,52 %
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	VaR relative	JP Morgan ESG Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified Index	66,74 %	46,85 %	56,34 %
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	VaR absolue	n/a	18,09 %	11,19 %	14,03 %
Sustainable Global Allocation Fund ⁽²⁾	VaR relative	60% MSCI All Country World Index, 40% Bloomberg Global Aggregate Index	56,98 %	37,39 %	50,79 %
Sustainable Global Bond Income Fund	VaR absolue	n/a	20,57 %	12,97 %	15,94 %
Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾	VaR relative	Bloomberg Global Aggregate USD Hedged Index	64,97 %	40,28 %	54,67 %
US Dollar Bond Fund	VaR relative	Bloomberg US Aggregate Index	57,51 %	42,27 %	51,12 %
US Dollar High Yield Bond Fund	VaR relative	Bloomberg US High Yield 2% Constrained Index	52,52 %	45,40 %	47,74 %
US Dollar Short Duration Bond Fund	VaR absolue	n/a	14,57 %	8,94 %	11,55 %
US Government Mortgage Impact Fund	VaR relative	Bloomberg US MBS Index	55,89 %	48,82 %	51,15 %

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)

suite

Effet de levier

Le recours à des instruments dérivés peut exposer les Compartiments à un risque plus grand. En particulier, les contrats sur instruments dérivés peuvent être très volatils et le montant de la marge initiale est généralement faible par rapport à l'importance du contrat, de manière à donner une marge de manœuvre aux transactions en termes d'exposition au marché. Une légère évolution du marché peut avoir plus d'impact sur les instruments dérivés que sur les obligations ou les actions standard. Les positions spéculatives en instruments dérivés peuvent donc accroître la volatilité des Compartiments.

L'effet de levier est calculé à partir de l'exposition brute, en prenant la somme des valeurs notionnelles des instruments dérivés utilisés par le Compartiment, sans compensation, et est exprimé en pourcentage de la valeur liquidative.

Le tableau ci-dessous indique le niveau d'effet de levier utilisé au cours de l'exercice.

Compartiment	Effet de levier moyen utilisé au cours de l'exercice
Asian High Yield Bond Fund	48%
Asian Multi-Asset Income Fund	42%
Asian Tiger Bond Fund	55%
China Bond Fund	114%
China Onshore Bond Fund ⁽²⁾	36%
Climate Action Multi-Asset Fund	76%
Dynamic High Income Fund	43%
Emerging Markets Bond Fund	44%
Emerging Markets Corporate Bond Fund	4%
Emerging Markets Impact Bond Fund	15%
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	231%
ESG Global Conservative Income Fund	117%
ESG Global Multi-Asset Income Fund	40%
ESG Multi-Asset Fund	99%
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾	32%
Euro Bond Fund	67%
Euro Corporate Bond Fund	84%
Euro Short Duration Bond Fund	93%
European High Yield Bond Fund	35%
Fixed Income Global Opportunities Fund	478%
Global Allocation Fund	122%
Global Corporate Bond Fund	209%
Global Dynamic Equity Fund	57%
Global Government Bond Fund	319%
Global High Yield Bond Fund	35%
Global Inflation Linked Bond Fund	287%
Global Multi-Asset Income Fund	40%
Impact Bond Fund ⁽²⁾	84%
Sustainable Asian Bond Fund	40%
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	147%
Sustainable Emerging Markets Bond Fund	46%
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	5%
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	193%
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	567%
Sustainable Global Allocation Fund ⁽²⁾	55%
Sustainable Global Bond Income Fund	123%
Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾	319%

Appendice II – Exposition globale et effet de levier (non révisé)

suite

Compartiment	Effet de levier moyen utilisé au cours de l'exercice
US Dollar Bond Fund	236%
US Dollar High Yield Bond Fund	13%
US Dollar Short Duration Bond Fund	88%
US Government Mortgage Impact Fund	62%

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Appendice III – Admissibilité au Plan d'épargne en actions français (« PEA ») (non révisé)

Un PEA est un plan d'épargne en actions français qui vise à encourager les particuliers résidents fiscaux en France à investir dans des actions européennes. Les Compartiments admissibles au PEA doivent investir en permanence au moins 75% de leurs actifs dans des titres admissibles au PEA émis par des sociétés (i) établies dans un État membre de l'Union européenne ou en Islande, au Liechtenstein ou en Norvège et (ii) soumises à l'impôt sur les sociétés ou à un impôt équivalent.

Tout au long de l'exercice clos le 31 août 2023, le Compartiment listé ci-dessous a investi plus de 75% du total de son actif net dans des titres admissibles au PEA.

Au 31 août 2023, le pourcentage suivant du total de l'actif net du Compartiment était investi dans des titres admissibles au PEA:

Compartiment	% investi dans des titres admissibles au PEA
Euro-Markets Fund	89,80

L'admissibilité au PEA de ce Compartiment dépend, à la connaissance de la Société, de la législation et des pratiques fiscales en France au 31 août 2023.

Les lois et pratiques fiscales peuvent varier, le cas échéant, et par conséquent un Compartiment qui peut actuellement être considéré comme étant éligible au PEA pourrait perdre son admissibilité.

En outre, les Compartiments pourraient perdre leur admissibilité au PEA en raison de changements affectant leur univers d'investissement ou leur indice de référence.

Dans le cas où un Compartiment perd son admissibilité au PEA, les investisseurs seront informés par la publication d'un avis sur le site Internet de la Société. Les investisseurs devront alors demander conseil auprès de conseillers fiscaux et financiers professionnels.

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé)

Techniques de gestion efficace de portefeuille

La Société est autorisée, pour le compte de certains Compartiments et sous réserve des conditions et des limites établies par la CSSF et le Prospectus, à utiliser des techniques et instruments liés aux titres négociables, y compris des investissements dans des instruments financiers dérivés (les « IFD ») de gré à gré, à condition que ces techniques et instruments soient utilisés en vue d'une gestion efficace de portefeuille, pour offrir une protection contre le risque de change ou à des fins d'investissement, s'il y a lieu.

En plus des investissements dans des IFD, la Société peut recourir à d'autres techniques et instruments liés aux titres négociables et aux instruments du marché monétaire, sous réserve des conditions indiquées dans la circulaire correspondante de la CSSF, telle que modifiée le cas échéant, et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF, comme les opérations de mise/prise en pension et les prêts de titres.

Prêts de titres

Toutes les opérations de prêt de titres conclues par les Compartiments sont soumises à un accord juridique écrit entre les Compartiments et l'Agent de prêts de titres, BlackRock Advisors (UK) Limited, une partie liée à la Société, et séparément entre l'Agent de prêts de titres et la contrepartie emprunteuse approuvée. La garantie reçue en échange de titres prêtés est transférée dans le cadre d'un accord de transfert de propriété et est délivrée et détenue sur un compte auprès d'un gestionnaire de garantie tripartite au nom du Dépositaire, The Bank of New York Mellon SA/ NV, succursale de Luxembourg pour le compte des Compartiments. La garantie reçue est séparée des actifs appartenant au Dépositaire des Compartiments ou à l'Agent de prêt.

Le tableau suivant présente la valeur des titres en prêt en tant que pourcentage du total d'actifs prêtables et de la VL des Compartiments au 31 août 2023. Le total des actifs prêtables représente la valeur globale des actifs faisant partie du programme de prêt de titres des Compartiments. Ceci à l'exclusion de tous actifs, détenus par les Compartiments, qui ne sont pas considérés comme prêtables en raison d'une quelconque restriction relative aux marchés, aux réglementations ou aux investissements, ou de toute autre restriction.

Compartiment	Devise	% des actifs prêtables	% de la VNI
Asian Dragon Fund	USD	1,81	0,88
Asian Growth Leaders Fund	USD	2,49	1,26
Asian High Yield Bond Fund	USD	14,61	12,04
Asian Multi-Asset Income Fund	USD	13,24	7,77
Asian Sustainable Equity Fund	USD	2,52	1,59
Asian Tiger Bond Fund	USD	17,75	16,16
China Bond Fund	CNH	8,57	3,35
China Flexible Equity Fund	USD	4,31	1,97
China Fund	USD	4,17	3,16
China Innovation Fund	USD	3,58	1,88
Circular Economy Fund	USD	8,97	8,67
Climate Action Equity Fund	USD	2,04	1,61
Climate Action Multi-Asset Fund	EUR	5,27	4,29
Continental European Flexible Fund	EUR	2,81	2,71
Developed Markets Sustainable Equity Fund	USD	4,51	4,28
Dynamic High Income Fund	USD	9,28	5,74
Emerging Europe Fund ⁽³⁾	EUR	3,76	2,78
Emerging Markets Bond Fund	USD	18,11	14,78
Emerging Markets Corporate Bond Fund	USD	15,69	15,55
Emerging Markets Equity Income Fund	USD	4,58	2,17
Emerging Markets Fund	USD	7,20	3,37
Emerging Markets Impact Bond Fund	USD	11,57	10,65
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	USD	21,40	8,96
Emerging Markets Sustainable Equity Fund	USD	2,95	0,64
ESG Flex Choice Cautious Fund	USD	5,72	5,66
ESG Flex Choice Growth Fund	USD	4,14	4,09
ESG Global Conservative Income Fund	EUR	6,72	4,63
ESG Global Multi-Asset Income Fund	USD	0,84	0,60
ESG Multi-Asset Fund	EUR	6,75	6,29
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾	USD	6,22	1,65
Euro Bond Fund	EUR	16,86	15,75
Euro Corporate Bond Fund	EUR	5,03	4,53
Euro Short Duration Bond Fund	EUR	22,85	20,69
Euro-Markets Fund	EUR	6,41	6,28
European Equity Income Fund	EUR	3,36	3,30

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Compartiment	Devise	% des actifs prêtables	% de la VNI
European Focus Fund	EUR	4,34	4,05
European Fund	EUR	5,80	5,45
European High Yield Bond Fund	EUR	13,26	11,90
European Special Situations Fund	EUR	6,72	6,33
European Sustainable Equity Fund	EUR	6,76	5,97
European Value Fund	EUR	1,19	1,15
FinTech Fund	USD	8,98	8,36
Fixed Income Global Opportunities Fund	USD	27,06	17,67
Future Consumer Fund	USD	7,80	7,00
Future Of Transport Fund	USD	5,13	4,64
Global Allocation Fund	USD	18,97	16,14
Global Corporate Bond Fund	USD	3,50	3,30
Global Dynamic Equity Fund	USD	11,39	9,32
Global Equity Income Fund	USD	3,24	2,87
Global Government Bond Fund	USD	12,42	9,75
Global High Yield Bond Fund	USD	7,49	7,06
Global Inflation Linked Bond Fund	USD	4,65	4,60
Global Long-Horizon Equity Fund	USD	2,42	2,23
Global Multi-Asset Income Fund	USD	6,35	4,06
Impact Bond Fund ⁽²⁾	EUR	1,67	1,53
Japan Flexible Equity Fund	JPY	34,45	33,41
Japan Small & MidCap Opportunities Fund	JPY	27,37	26,25
Latin American Fund	USD	12,59	5,86
Next Generation Health Care Fund	USD	11,55	10,16
Next Generation Technology Fund	USD	13,02	11,25
Nutrition Fund	USD	13,88	12,99
Sustainable Asian Bond Fund	USD	14,10	12,91
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	USD	24,75	17,51
Sustainable Emerging Markets Bond Fund	USD	10,98	10,08
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	USD	16,58	16,32
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	USD	18,76	8,59
Sustainable Energy Fund	USD	5,46	4,91
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	EUR	4,66	2,72
Sustainable Global Bond Income Fund	USD	7,06	4,63
Sustainable Global Infrastructure Fund	USD	11,26	10,16
Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾	USD	11,75	7,04
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund ⁽⁵⁾	CHF	12,08	11,76
Systematic Global Equity High Income Fund	USD	8,28	6,73
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund ⁽²⁾	USD	1,08	0,46
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund ⁽⁴⁾	USD	24,34	20,57
United Kingdom Fund	GBP	3,26	3,23
US Basic Value Fund	USD	9,82	9,31
US Dollar Bond Fund	USD	2,52	1,40
US Dollar High Yield Bond Fund	USD	6,04	5,64
US Dollar Short Duration Bond Fund	USD	11,80	7,97
US Flexible Equity Fund	USD	7,16	7,05
US Growth Fund	USD	9,52	9,40
US Mid-Cap Value Fund	USD	12,75	12,10
US Sustainable Equity Fund	USD	5,76	4,59
World Energy Fund	USD	5,25	5,01
World Financials Fund	USD	5,14	4,46
World Gold Fund	USD	9,74	9,45
World Healthscience Fund	USD	3,53	3,45
World Mining Fund	USD	10,17	9,34
World Real Estate Securities Fund	USD	9,08	8,86
World Technology Fund	USD	7,25	6,91

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Le revenu perçu durant l'exercice par les Compartiments et issu des opérations de prêt de titres est indiqué dans le compte de résultat et l'évolution de l'actif net des Compartiments.

Le revenu total généré par les opérations de prêt de titres est divisé entre le Compartiment concerné et l'Agent de prêt de titres. Les Compartiments reçoivent au moins 62,5 %, tandis que l'Agent de prêt de titres reçoit jusqu'à 37,5 % de ce revenu, tous les coûts opérationnels étant prélevés sur la part de l'Agent de prêt de titres.

Le tableau suivant présente la valeur des titres en prêt (identifiés individuellement dans le portefeuille de titres des Compartiments concernés) et la garantie associée reçue, analysées par contrepartie au 31 août 2023.

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Asian Dragon Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	4.533.780	4.983.000
UBS AG	Suisse	2.386.200	2.649.301
Total		6.919.980	7.632.301
Asian Growth Leaders Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	497.125	547.085
BNP Paribas SA	France	6.955.972	7.635.276
Total		7.453.097	8.182.361
Asian High Yield Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	47.707.285	49.994.647
BNP Paribas SA	France	4.187.774	4.351.064
Deutsche Bank AG	Allemagne	50.926.664	55.591.051
Goldman Sachs International	États-Unis	10.661.542	11.093.386
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	8.336.064	8.809.003
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	36.207.933	38.108.718
Nomura International Plc	Japon	17.801.409	19.131.398
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	5.976.954	6.830.599
UBS AG	Suisse	591.661	654.732
Total		182.397.286	194.564.598
Asian Multi-Asset Income Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	1.183.861	1.271.966
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	7.016	7.583
BNP Paribas SA	France	553.310	589.408
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	112.866	132.048
Credit Suisse AG	Suisse	6.952	7.488
Deutsche Bank AG	Allemagne	916.072	1.025.237
Goldman Sachs International	États-Unis	333.740	356.515
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	833.591	907.425
Macquarie Bank Limited	Australie	614.111	699.788
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	820.290	885.163
UBS AG	Suisse	25.626	29.234
Total		5.407.435	5.911.855
Asian Sustainable Equity Fund (en USD)			
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	133.459	145.587
Total		133.459	145.587
Asian Tiger Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	138.193.904	148.145.277
BNP Paribas SA	France	26.538.797	28.206.790
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	6.611.861	7.313.719
Credit Suisse International	Royaume-Uni	1.439.552	1.532.309
Deutsche Bank AG	Allemagne	59.335.539	66.257.413
Goldman Sachs International	États-Unis	41.498.922	44.171.378
ING Bank NV	Pays-Bas	2.388.496	2.554.298
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	27.223.200	30.049.606
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	16.937.478	18.176.881
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	36.748.925	39.566.303
Nomura International Plc	Japon	72.457.250	79.658.876
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	479.334	560.373
UBS AG	Suisse	752.770	852.144
Zürcher Kantonalbank	Suisse	20.905.379	23.618.093
Total		451.511.407	490.663.460

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
China Bond Fund (en CNH)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	300.199.380	316.368.522
Deutsche Bank AG	Allemagne	115.142.153	126.397.467
Goldman Sachs International	États-Unis	26.621.215	27.855.855
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	107.279.352	115.185.911
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	10.116.792	11.248.948
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	168.187.178	178.015.659
Nomura International Plc	Japon	147.890.270	159.836.666
UBS AG	Suisse	3.620.512	3.793.329
Total		879.056.852	938.702.357
China Flexible Equity Fund (en USD)			
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	431.016	473.252
Total		431.016	473.252
China Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	3.353.130	4.702.897
Credit Suisse AG	Suisse	13.063.559	17.472.674
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	5.125.009	7.243.844
Societe Generale SA	France	2.729.740	3.868.019
UBS AG	Suisse	7.976.099	11.300.551
Total		32.247.537	44.587.985
China Innovation Fund (en USD)			
UBS AG	Suisse	390.946	429.888
Total		390.946	429.888
Circular Economy Fund (en USD)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	20.054.935	21.836.928
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	70.116.348	76.552.887
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	16.563.464	17.251.704
BNP Paribas SA	France	2.383.855	2.595.972
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	16.939.981	19.098.282
Credit Suisse International	Royaume-Uni	149.228	155.393
Goldman Sachs International	États-Unis	982.081	1.055.609
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	2.946.442	3.161.232
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.265.384	1.387.744
Societe Generale SA	France	1.402.166	1.541.628
The Bank of Nova Scotia	Canada	2.541.604	2.711.792
UBS AG	Suisse	8.848.411	9.727.186
Total		144.193.899	157.076.357
Climate Action Equity Fund (en USD)			
Goldman Sachs International	États-Unis	73.305	76.262
Total		73.305	76.262
Climate Action Multi-Asset Fund (en EUR)			
BNP Paribas SA	France	1.109.485	1.205.768
Credit Suisse International	Royaume-Uni	147.378	153.156
Goldman Sachs International	États-Unis	96.210	103.205
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	349.349	374.059
The Bank of Nova Scotia	Canada	112.679	119.981
UBS AG	Suisse	138.317	151.747
Total		1.953.418	2.107.916

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Continental European Flexible Fund (en EUR)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	2.585.260	2.758.689
BNP Paribas SA	France	5.796.872	6.467.429
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	21.880.436	25.272.897
Credit Suisse International	Royaume-Uni	13.256.749	14.142.788
Goldman Sachs International	États-Unis	17.424.995	19.188.725
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	2.988.152	3.284.572
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	2.403.675	2.700.727
Macquarie Bank Limited	Australie	11.248.530	12.654.453
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	53.641.815	62.455.589
Societe Generale SA	France	4.741.124	5.340.464
UBS AG	Suisse	8.279.030	9.324.361
Total		144.246.638	163.590.694
Developed Markets Sustainable Equity Fund (en USD)			
UBS AG	Suisse	740.718	816.343
Total		740.718	816.343
Dynamic High Income Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	29.707.805	32.543.682
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	841.265	892.858
BNP Paribas SA	France	30.400.025	32.648.704
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	14.544.975	15.851.459
Credit Suisse International	Royaume-Uni	444.110	471.237
Deutsche Bank AG	Allemagne	1.268.672	1.394.193
Goldman Sachs International	États-Unis	11.380.676	12.009.557
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	5.964.289	6.520.571
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	36.991.825	40.666.069
Macquarie Bank Limited	Australie	4.590.997	5.136.951
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	10.276.843	10.889.163
The Bank of Nova Scotia	Canada	3.554.169	3.864.160
UBS AG	Suisse	10.508.607	11.771.601
Zürcher Kantonalbank	Suisse	2.087.698	2.321.178
Total		162.561.956	176.981.383
Emerging Europe Fund (en EUR)⁽³⁾			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	650.742	663.235
BNP Paribas SA	France	2.467.295	2.629.169
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	502	553
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.122.008	1.204.095
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.022.639	2.249.293
UBS AG	Suisse	1.235.025	1.328.542
Total		7.498.211	8.074.887
Emerging Markets Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	55.728.965	58.779.944
BNP Paribas SA	France	8.479.524	8.867.337
Deutsche Bank AG	Allemagne	2.800.358	3.076.681
Goldman Sachs International	États-Unis	891.232	933.348
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	3.434.111	3.665.616
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	17.175.545	18.113.013
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	6.368.531	6.746.355
Nomura International Plc	Japon	38.318.320	41.448.439
Zürcher Kantonalbank	Suisse	12.102.548	13.452.803
Total		145.299.134	155.083.536

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	31.740.590	33.376.438
BNP Paribas SA	France	10.407.394	10.850.271
Credit Suisse International	Royaume-Uni	721.609	753.439
Deutsche Bank AG	Allemagne	5.530.942	6.058.215
Goldman Sachs International	États-Unis	23.287.447	24.313.752
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	18.162.277	19.272.541
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	6.661.338	7.035.066
Nomura International Plc	Japon	22.652.473	24.428.344
UBS AG	Suisse	2.107.875	2.314.443
Total		121.271.945	128.402.509
Emerging Markets Equity Income Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	1.460.117	1.815.644
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	846.125	1.036.612
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	300.016	375.712
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	1.823.818	2.366.761
Total		4.430.076	5.594.729
Emerging Markets Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	53.818.749	61.143.536
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	11.017.914	11.941.390
BNP Paribas SA	France	8.835.239	10.005.085
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.652.542	1.885.882
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	1.438.642	1.733.150
Societe Generale SA	France	1.630.893	1.865.865
UBS AG	Suisse	6.082.330	6.957.714
Total		84.476.309	95.532.622
Emerging Markets Impact Bond Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	3.852.946	4.047.717
Goldman Sachs International	États-Unis	5.303.948	5.580.178
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	667.650	726.756
Total		9.824.544	10.354.651
Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	69.563.838	77.665.621
BNP Paribas SA	France	14.641.964	16.213.024
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	33.725.183	38.410.839
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	8.343.033	9.313.118
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	11.466.042	12.856.984
Nomura International Plc	Japon	1.954.649	2.238.005
The Bank of Nova Scotia	Canada	3.925.737	4.461.784
Zürcher Kantonalbank	Suisse	2.304.360	2.711.300
Total		145.924.806	163.870.675
Emerging Markets Sustainable Equity Fund (en USD)			
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	495.130	1.044.116
Total		495.130	1.044.116
ESG Flex Choice Cautious Fund (en USD)			
Goldman Sachs International	États-Unis	556.067	583.536
Total		556.067	583.536
ESG Flex Choice Growth Fund (en USD)			
Goldman Sachs International	États-Unis	507.026	527.513
Total		507.026	527.513

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
ESG Global Conservative Income Fund (en EUR)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	5.150.916	5.563.286
BNP Paribas SA	France	3.736.886	4.001.568
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	389.188	457.724
Credit Suisse International	Royaume-Uni	469.813	503.840
Deutsche Bank AG	Allemagne	305.018	343.156
Goldman Sachs International	États-Unis	1.293.300	1.386.920
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	4.816.993	5.241.735
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	352.225	382.076
Societe Generale SA	France	179.617	212.369
UBS AG	Suisse	303.479	325.869
Total		16.997.435	18.418.543
ESG Global Multi-Asset Income Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	166.694	191.029
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	544.500	614.777
UBS AG	Suisse	291.871	337.655
Total		1.003.065	1.143.461
ESG Multi-Asset Fund (en EUR)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	538.661	581.038
BNP Paribas SA	France	77.749.649	86.974.309
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	41.119.167	45.044.165
Deutsche Bank AG	Allemagne	182.693	204.049
Goldman Sachs International	États-Unis	9.234.981	9.927.619
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	49.195.413	55.228.252
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	23.541.135	26.261.578
Macquarie Bank Limited	Australie	4.964.448	5.645.594
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	9.595.195	11.504.592
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	12.698.305	14.493.625
Societe Generale SA	France	100.052.546	112.557.888
The Bank of Nova Scotia	Canada	1.620.666	1.790.815
UBS AG	Suisse	50.672.003	57.689.768
Total		381.164.862	427.903.292
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (en USD)⁽⁴⁾			
BNP Paribas SA	France	809.694	844.150
Goldman Sachs International	États-Unis	201.708	210.598
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	509.188	537.756
Total		1.520.590	1.592.504
Euro Bond Fund (en EUR)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	4.927.147	5.422.211
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	28.704.558	30.089.540
BNP Paribas SA	France	14.123.649	14.829.993
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	6.070.207	6.396.175
Credit Suisse International	Royaume-Uni	65.149	67.810
Deutsche Bank AG	Allemagne	3.548.473	3.874.600
Goldman Sachs International	États-Unis	757.387	788.292
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	32.184.736	34.733.200
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	6.065.799	6.357.468
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	13.688.195	14.275.163
Natixis SA	France	17.934.069	19.765.492
Nomura International Plc	Japon	9.968.099	10.347.760
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	1.984.021	2.268.040
Societe Generale SA	France	130.549.521	145.704.723
The Bank of Nova Scotia	Canada	36.145.469	39.401.335
UBS AG	Suisse	122.991	128.175
Total		306.839.470	334.449.977

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Euro Corporate Bond Fund (en EUR)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	6.512.832	7.269.754
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	45.084.256	48.179.303
BNP Paribas SA	France	9.460.199	10.023.264
Deutsche Bank AG	Allemagne	7.439.911	8.281.796
Goldman Sachs International	États-Unis	12.349.983	13.104.099
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	16.557.914	18.262.023
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	8.331.919	8.942.574
Nomura International Plc	Japon	1.238.115	1.356.908
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	4.604.062	5.365.577
Societe Generale SA	France	1.546.489	1.809.167
UBS AG	Suisse	315.651	356.200
Zürcher Kantonalbank	Suisse	13.672.226	15.397.941
Total		127.113.557	138.348.606
Euro Short Duration Bond Fund (en EUR)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	5.329.904	5.671.578
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	17.655.168	17.986.307
BNP Paribas SA	France	37.950.000	38.137.862
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	22.112.240	22.189.642
Deutsche Bank AG	Allemagne	1.943.508	2.062.421
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	24.341.186	24.871.512
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	6.564.950	6.687.033
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	5.877.459	5.877.157
Natixis SA	France	256.790.817	275.051.321
Nomura International Plc	Japon	458.586	479.120
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	6.697.579	7.440.949
Societe Generale SA	France	132.796.747	148.094.782
The Bank of Nova Scotia	Canada	305.103.244	323.228.474
Zürcher Kantonalbank	Suisse	156.863.991	165.387.970
Total		980.485.379	1.043.166.128
Euro-Markets Fund (en EUR)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	21.794.736	22.312.337
BNP Paribas SA	France	23.360.404	25.004.216
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	4.722.951	5.233.683
Credit Suisse International	Royaume-Uni	736.456	753.771
Goldman Sachs International	États-Unis	6.274.992	6.629.513
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	4.721.371	4.978.967
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	10.457.801	11.273.019
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.191.818	2.448.315
UBS AG	Suisse	6.039.813	6.526.165
Total		80.300.342	85.159.986
European Equity Income Fund (en EUR)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	470.010	485.528
BNP Paribas SA	France	9.349.167	10.097.644
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	11.743.713	13.131.479
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	3.341.987	3.556.232
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	23.090.196	25.115.495
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	3.215.149	3.623.915
The Bank of Nova Scotia	Canada	411.712	435.681
Total		51.621.934	56.445.974

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
European Focus Fund (en EUR)			
BNP Paribas SA	France	875.504	1.044.111
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	1.345.421	1.661.147
Credit Suisse International	Royaume-Uni	520.781	593.887
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	5.522.948	6.633.253
Macquarie Bank Limited	Australie	1.183.466	1.423.161
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.175.924	2.708.085
UBS AG	Suisse	2.145.016	2.582.384
Total		13.769.060	16.646.028
European Fund (en EUR)			
BNP Paribas SA	France	9.569.371	10.295.571
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	152.663	170.045
Credit Suisse International	Royaume-Uni	321.499	330.756
Goldman Sachs International	États-Unis	6.212.038	6.596.851
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.076.788	1.141.393
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	45.918.867	51.557.055
The Bank of Nova Scotia	Canada	217.008	228.755
UBS AG	Suisse	9.467.427	10.282.546
Total		72.935.661	80.602.972
European High Yield Bond Fund (en EUR)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	14.542.962	15.301.653
BNP Paribas SA	France	2.487.703	2.595.120
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	456.177	495.261
Deutsche Bank AG	Allemagne	2.028.545	2.223.262
Goldman Sachs International	États-Unis	3.221.486	3.365.480
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	6.953.555	7.413.200
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	7.402.760	7.822.778
Nomura International Plc	Japon	610.994	659.290
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	299.306	343.432
UBS AG	Suisse	161.012	168.426
Total		38.164.500	40.387.902
European Special Situations Fund (en EUR)			
BNP Paribas SA	France	6.900.324	7.451.611
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	1.308.351	1.462.737
Credit Suisse International	Royaume-Uni	439.236	453.564
Goldman Sachs International	États-Unis	1.024.280	1.091.779
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.517.546	1.614.584
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	43.316.460	48.816.149
UBS AG	Suisse	23.896.943	26.051.016
Total		78.403.140	86.941.440
European Sustainable Equity Fund (en EUR)			
BNP Paribas SA	France	259.382	276.653
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	73.176	81.451
Total		332.558	358.104
European Value Fund (en EUR)			
BNP Paribas SA	France	580.812	623.700
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	3.420.185	3.802.338
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	457.108	483.612
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	2.403.021	2.598.751
UBS AG	Suisse	1.469.871	1.593.385
Total		8.330.997	9.101.786
FinTech Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	412.078	452.374
Goldman Sachs International	États-Unis	196.753	213.194
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	367.751	397.751
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	8.245.985	9.116.499
The Bank of Nova Scotia	Canada	2.462.788	2.648.950
UBS AG	Suisse	9.668.368	10.714.537
Total		21.353.723	23.543.305

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Fixed Income Global Opportunities Fund (en USD)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	12.020.453	13.348.022
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	39.587.513	41.719.737
BNP Paribas SA	France	53.297.398	58.036.599
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	2.460.433	2.675.534
Credit Suisse International	Royaume-Uni	1.192.078	1.247.407
Deutsche Bank AG	Allemagne	8.415.986	9.238.661
Goldman Sachs International	États-Unis	24.302.313	25.429.404
HSBC	Hong Kong	319.781.706	355.121.951
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.332.292	1.454.979
ING Bank NV	Pays-Bas	2.377.681	2.499.685
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	37.652.530	40.075.312
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	18.591.817	20.347.715
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	9.003.350	9.530.129
Natixis SA	France	111.246.770	122.940.699
Nomura International Plc	Japon	28.373.099	30.116.363
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	7.319.625	8.412.254
Societe Generale SA	France	245.062.758	270.496.666
The Bank of Nova Scotia	Canada	82.271.319	88.263.248
UBS AG	Suisse	9.113.862	10.198.195
Zürcher Kantonalbank	Suisse	262.917.922	283.146.597
Total		1.276.320.905	1.394.299.157
Future Consumer Fund (en USD)			
UBS AG	Suisse	905.775	1.003.813
Total		905.775	1.003.813
Future Of Transport Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	7.179.307	7.757.876
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	12.554.108	14.044.536
Goldman Sachs International	États-Unis	19.638.754	20.946.420
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	23.787.124	25.324.474
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	2.454.320	2.819.550
UBS AG	Suisse	19.227.411	20.974.077
Total		84.841.024	91.866.933
Global Allocation Fund (en USD)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	52.792.342	57.827.057
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	139.177.399	150.068.702
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	404.883	423.422
BNP Paribas SA	France	170.152.715	185.433.476
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	36.982.005	41.863.452
Credit Suisse International	Royaume-Uni	5.001.365	5.223.234
Deutsche Bank AG	Allemagne	4.293.828	4.649.572
Goldman Sachs International	États-Unis	33.635.207	35.000.833
HSBC	Hong Kong	41.393.074	45.343.536
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	211.526.267	228.741.323
ING Bank NV	Pays-Bas	8.998.901	9.332.217
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	280.577.099	306.577.835
Macquarie Bank Limited	Australie	4.226.023	4.659.346
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	56.348.375	63.852.567
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	32.997.136	35.090.062
Nomura International Plc	Japon	183.721.233	189.696.156
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	3.821.571	4.332.409
Societe Generale SA	France	333.039.991	372.288.689
The Bank of Nova Scotia	Canada	209.104.672	225.653.992
UBS AG	Suisse	83.416.161	92.073.640
Zürcher Kantonalbank	Suisse	441.362.714	469.367.951
Total		2.332.972.961	2.527.499.471

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Global Corporate Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	5.978.415	6.413.995
BNP Paribas SA	France	1.036.895	1.102.937
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	285.425	315.974
Deutsche Bank AG	Allemagne	438.070	489.560
Goldman Sachs International	États-Unis	8.199.338	8.734.271
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	4.643.390	5.135.979
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	632.634	678.620
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	739.572	796.901
Nomura International Plc	Japon	4.960.847	5.458.232
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	979.939	1.146.520
Zürcher Kantonalbank	Suisse	1.115.947	1.261.751
Total		29.010.472	31.534.740
Global Dynamic Equity Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	6.825.120	7.334.715
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	8.159.808	9.084.613
Goldman Sachs International	États-Unis	92.211	97.877
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	4.536.051	4.805.976
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	862.388	933.974
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	3.258.578	3.725.477
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	1.250.629	1.403.536
Natixis SA	France	1.151.108	1.376.298
Societe Generale SA	France	6.849.610	7.436.885
The Bank of Nova Scotia	Canada	118.670	125.036
UBS AG	Suisse	5.016.259	5.445.616
Total		38.120.432	41.770.003
Global Equity Income Fund (en USD)			
Credit Suisse International	Royaume-Uni	2.424.403	2.527.309
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	19.608.812	21.061.190
UBS AG	Suisse	4.306.600	4.739.468
Total		26.339.815	28.327.967
Global Government Bond Fund (en USD)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	2.561.777	3.076.235
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	569.294	630.495
BNP Paribas SA	France	8.637.054	9.623.531
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	2.603.544	2.840.250
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	15.561.779	17.700.568
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.096.826	2.320.496
Natixis SA	France	7.024.185	8.179.078
Nomura International Plc	Japon	746.416	847.775
Societe Generale SA	France	36.716.412	42.783.762
The Bank of Nova Scotia	Canada	22.872.452	26.437.889
Total		99.389.739	114.440.079

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Global High Yield Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	27.388.457	29.208.662
BNP Paribas SA	France	11.695.738	12.340.962
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	97.611	107.192
Credit Suisse International	Royaume-Uni	1.453.082	1.535.528
Deutsche Bank AG	Allemagne	8.105.158	8.985.246
Goldman Sachs International	États-Unis	19.204.771	20.293.748
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	3.401.617	3.747.367
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	20.590.093	22.291.278
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	1.230.017	1.308.853
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	16.998.733	18.169.633
Nomura International Plc	Japon	575.549	628.179
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	2.206.484	2.560.876
Societe Generale SA	France	737.049	858.699
The Bank of Nova Scotia	Canada	1.045.475	1.219.967
UBS AG	Suisse	1.397.716	1.572.288
Zürcher Kantonalbank	Suisse	1.388.897	1.557.779
Total		117.516.447	126.386.257
Global Inflation Linked Bond Fund (en USD)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	1.698.958	2.231.564
BNP Paribas SA	France	6.832.814	8.893.770
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	468.722	575.542
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	1.225.355	1.499.285
Societe Generale SA	France	2.214.489	3.021.934
Total		12.440.338	16.222.095
Global Long-Horizon Equity Fund (en USD)			
Goldman Sachs International	États-Unis	28.942.168	30.159.857
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	2.000.902	2.127.431
Total		30.943.070	32.287.288
Global Multi-Asset Income Fund (en USD)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	185.327	205.223
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	15.436.006	16.679.506
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	21.509.316	22.940.080
BNP Paribas SA	France	18.174.606	19.375.607
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	5.395.691	6.010.356
Credit Suisse International	Royaume-Uni	4.839.034	5.135.452
Deutsche Bank AG	Allemagne	6.738.619	7.441.551
Goldman Sachs International	États-Unis	11.359.340	12.011.542
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	11.361.425	12.476.192
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	31.676.093	34.437.809
Macquarie Bank Limited	Australie	6.890.813	7.747.969
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	2.391.849	2.537.006
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	21.941.760	23.531.747
Nomura International Plc	Japon	2.134.831	2.321.072
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	2.640.130	3.052.370
Societe Generale SA	France	4.118.774	4.770.673
The Bank of Nova Scotia	Canada	5.556.545	6.070.728
UBS AG	Suisse	24.396.320	27.437.669
Total		196.746.479	214.182.552
Impact Bond Fund (en EUR)⁽²⁾			
BNP Paribas SA	France	697.336	724.770
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	471.917	486.773
Total		1.169.253	1.211.543

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Japan Flexible Equity Fund (en JPY)			
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	1.920.020.195	2.167.431.048
Goldman Sachs International	États-Unis	13.073.875	14.070.783
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	733.142.093	787.598.202
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.185.271.829	1.301.557.406
Macquarie Bank Limited	Australie	529.529.725	582.208.260
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	4.711.139.097	5.461.257.226
Societe Generale SA	France	1.484.308.494	1.634.038.808
UBS AG	Suisse	1.128.330.771	1.241.985.314
Total		11.704.816.079	13.190.147.047
Japan Small & MidCap Opportunities Fund (en JPY)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	664.007.897	663.918.835
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	851.101.621	921.135.926
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	226.892.040	233.689.193
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	274.856.470	289.370.433
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	2.352.827.257	2.614.926.967
Societe Generale SA	France	350.141.975	369.560.197
UBS AG	Suisse	911.927.250	962.372.113
Total		5.631.754.510	6.054.973.664
Latin American Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	8.617.815	9.544.339
BNP Paribas SA	France	16.697.940	18.433.045
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	20.316.883	22.602.200
UBS AG	Suisse	9.278.382	10.346.669
Total		54.911.020	60.926.253
Natural Resources Fund (en USD)⁽⁷⁾			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	6.299.060	6.845.283
BNP Paribas SA	France	1.979.606	2.145.717
Goldman Sachs International	États-Unis	3.966.217	4.243.318
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	13.821.842	15.087.820
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.077.441	2.349.916
UBS AG	Suisse	4.057.438	4.439.634
Total		32.201.604	35.111.688
Next Generation Health Care Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	120.941	132.784
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	723.733	800.237
The Bank of Nova Scotia	Canada	62.542	67.278
UBS AG	Suisse	958.626	1.062.490
Total		1.865.842	2.062.789
Next Generation Technology Fund (en USD)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	33.824.065	35.250.048
BNP Paribas SA	France	70.270.669	76.568.023
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	10.803.608	12.187.182
Goldman Sachs International	États-Unis	4.384.063	4.715.043
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	16.549.721	17.766.514
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	15.800.453	17.338.434
Macquarie Bank Limited	Australie	7.220.916	7.933.691
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	19.807.990	22.945.741
Societe Generale SA	France	1.213.395	1.334.859
The Bank of Nova Scotia	Canada	16.075.351	17.161.767
UBS AG	Suisse	92.582.981	101.837.130
Total		288.533.212	315.038.432

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Nutrition Fund (en USD)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	798.629	826.853
BNP Paribas SA	France	17.970.111	19.440.998
Goldman Sachs International	États-Unis	5.974.535	6.383.549
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	4.447.184	4.742.921
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	525.585	572.971
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	3.089.607	3.490.243
UBS AG	Suisse	2.404.712	2.627.770
Total		35.210.363	38.085.305
Sustainable Asian Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	7.142.717	7.342.561
Deutsche Bank AG	Allemagne	2.769.450	2.965.504
Goldman Sachs International	États-Unis	3.501.890	3.574.308
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	470.100	485.351
UBS AG	Suisse	601.491	652.928
Total		14.485.648	15.020.652
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	2.856.813	3.000.247
BNP Paribas SA	France	631.535	657.684
Deutsche Bank AG	Allemagne	220.943	241.697
Goldman Sachs International	États-Unis	362.195	377.674
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.757.594	1.860.127
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	1.664.672	1.751.868
Total		7.493.752	7.889.297
Sustainable Emerging Markets Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	8.441.982	8.949.722
BNP Paribas SA	France	2.235.639	2.349.850
Deutsche Bank AG	Allemagne	2.492.046	2.751.959
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	5.533.777	6.012.898
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	3.082.493	3.282.080
Total		21.785.937	23.346.509
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	652.533	679.950
BNP Paribas SA	France	2.177.013	2.249.101
Deutsche Bank AG	Allemagne	839.939	911.681
Goldman Sachs International	États-Unis	2.527.467	2.614.956
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	2.143.088	2.247.264
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	330.157	345.523
Total		8.670.197	9.048.475
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	16.550.599	18.708.866
BNP Paribas SA	France	10.677.682	11.968.165
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	9.259.553	10.609.717
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	7.037.499	7.989.298
Total		43.525.333	49.276.046
Sustainable Energy Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	48.651.511	52.556.706
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	86.859	89.513
BNP Paribas SA	France	98.296.602	105.849.437
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	26.869.792	29.973.345
Credit Suisse International	Royaume-Uni	2.932.194	3.021.083
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	75.655.770	80.313.774
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	8.583.987	9.314.635
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	21.295.709	24.394.406
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	23.830.152	26.795.788
Societe Generale SA	France	832.916	906.089
UBS AG	Suisse	33.684.248	36.638.551
Total		340.719.740	369.853.327

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (en EUR)			
BNP Paribas SA	France	2.360.405	2.615.134
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	7.854	9.505
Deutsche Bank AG	Allemagne	591.003	684.233
Goldman Sachs International	États-Unis	2.782.087	3.070.217
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	4.846.337	5.463.777
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	605.686	752.775
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	833.277	930.174
The Bank of Nova Scotia	Canada	1.185.781	1.370.536
UBS AG	Suisse	592.864	699.658
Total		13.805.294	15.596.009
Sustainable Global Bond Income Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	739.510	798.358
BNP Paribas SA	France	1.103.893	1.181.555
Goldman Sachs International	États-Unis	730.950	783.513
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.114.950	1.215.344
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	1.466.326	1.589.883
Total		5.155.629	5.568.653
Sustainable Global Infrastructure Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	701.687	763.163
Credit Suisse International	Royaume-Uni	481.596	500.862
Total		1.183.283	1.264.025
Sustainable World Bond Fund (en USD)⁽⁴⁾			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	7.720.243	9.483.820
BNP Paribas SA	France	9.512.108	11.588.021
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	9.269.074	11.614.432
Deutsche Bank AG	Allemagne	1.125.130	1.439.712
Goldman Sachs International	États-Unis	3.616.309	4.410.858
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	12.650.428	16.198.192
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	3.372.319	4.142.027
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.858.556	3.512.691
Nomura International Plc	Japon	1.010.412	1.272.929
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	1.713.727	2.295.799
Societe Generale SA	France	6.365.409	8.560.030
The Bank of Nova Scotia	Canada	607.370	759.546
UBS AG	Suisse	1.225.723	1.496.967
Zürcher Kantonalbank	Suisse	4.070.656	5.216.136
Total		65.117.464	81.991.160
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (en CHF)⁽⁵⁾			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	194.245	201.201
BNP Paribas SA	France	3.636.228	3.937.959
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	4.024.701	4.512.476
Credit Suisse International	Royaume-Uni	1.349.610	1.397.618
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	4.804.113	5.125.917
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	17.958.861	19.586.909
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	16.708.534	18.883.756
Societe Generale SA	France	6.281.768	6.868.499
The Bank of Nova Scotia	Canada	10.738.964	11.394.905
UBS AG	Suisse	4.956.499	5.418.721
Total		70.653.523	77.327.961

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
Systematic Global Equity High Income Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	15.350.261	16.959.978
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	6.363.264	6.706.996
BNP Paribas SA	France	101.623.068	111.915.796
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	52.859.133	60.307.135
Credit Suisse AG	Suisse	292.344	307.024
Credit Suisse International	Royaume-Uni	1.380.388	1.454.617
Goldman Sachs International	États-Unis	2.730.776	2.970.360
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	67.726.840	73.533.720
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	9.570.718	10.621.823
Macquarie Bank Limited	Australie	4.703.682	5.226.791
Societe Generale SA	France	53.418.308	59.434.342
The Bank of Nova Scotia	Canada	5.927.318	6.399.911
UBS AG	Suisse	15.090.282	16.787.519
Total		337.036.382	372.626.012
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund (en USD)⁽²⁾			
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	100.956	109.154
Total		100.956	109.154
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund (en USD)⁽⁴⁾			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	1.014.217	1.055.693
BNP Paribas SA	France	11.645.973	12.665.878
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	3.012.476	3.394.147
Goldman Sachs International	États-Unis	1.841.789	1.978.433
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.426.530	1.529.555
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	7.064.083	7.742.279
Macquarie Bank Limited	Australie	675.001	740.730
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	9.478.695	10.966.875
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.311.377	2.625.106
Societe Generale SA	France	480.516	527.975
The Bank of Nova Scotia	Canada	868.817	926.409
UBS AG	Suisse	12.692.671	13.944.427
Total		52.512.145	58.097.507
United Kingdom Fund (en GBP)			
BNP Paribas SA	France	3.780.178	4.120.078
Credit Suisse International	Royaume-Uni	183.897	191.787
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	271.192	291.408
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	148.389	162.988
The Bank of Nova Scotia	Canada	59.686	63.780
UBS AG	Suisse	2.430.641	2.676.137
Total		6.873.983	7.506.178
US Basic Value Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	48.605.951	53.019.112
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	3.581.562	4.047.334
Goldman Sachs International	États-Unis	1.895.241	2.041.905
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	7.657.307	8.417.411
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	3.552.095	4.122.004
Societe Generale SA	France	17.559	19.351
The Bank of Nova Scotia	Canada	129.991	139.020
UBS AG	Suisse	17.388.881	19.160.584
Total		82.828.587	90.966.721

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
US Dollar Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	982.553	1.051.299
BNP Paribas SA	France	1.589.119	1.775.406
Deutsche Bank AG	Allemagne	59.129	65.901
Goldman Sachs International	États-Unis	156.199	165.941
ING Bank NV	Pays-Bas	1.320.256	1.666.095
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	875.319	939.577
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	268.734	288.785
Natixis SA	France	1.010.247	1.133.503
Nomura International Plc	Japon	374.286	410.702
Societe Generale SA	France	1.132.458	1.326.442
Total		7.768.300	8.823.651
US Dollar High Yield Bond Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	24.395.163	25.665.764
BNP Paribas SA	France	17.706.755	18.469.827
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	107.289	116.472
Credit Suisse International	Royaume-Uni	2.616.331	2.733.147
Deutsche Bank AG	Allemagne	934.209	1.023.799
Goldman Sachs International	États-Unis	14.711.687	15.368.036
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	132.086	142.759
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	22.490.884	24.425.595
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	3.123.104	3.285.252
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	9.507.281	10.045.891
Nomura International Plc	Japon	2.279.022	2.458.965
RBC Europe Limited	Royaume-Uni	351.426	403.203
Societe Generale SA	France	901.392	1.038.151
UBS AG	Suisse	4.823.188	5.368.493
Zürcher Kantonalbank	Suisse	2.254.332	2.499.517
Total		106.334.149	113.044.871
US Dollar Short Duration Bond Fund (en USD)			
Banco Santander, S.A.	Espagne	60.897.883	67.172.379
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	2.325.408	2.434.308
BNP Paribas SA	France	313.262	325.131
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	206.517	223.073
Goldman Sachs International	États-Unis	2.226.496	2.314.214
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	480.384	504.350
Nomura International Plc	Japon	771.300	828.042
Societe Generale SA	France	61.677.152	67.608.036
Total		128.898.402	141.409.533
US Flexible Equity Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	94.141.360	104.900.506
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	8.060.197	8.854.691
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	13.749.478	15.439.839
UBS AG	Suisse	16.663.070	18.756.259
Total		132.614.105	147.951.295
US Growth Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	24.307.754	26.670.168
Credit Suisse International	Royaume-Uni	816.618	857.338
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	4.894.337	5.294.262
The Bank of Nova Scotia	Canada	9.136	9.827
UBS AG	Suisse	6.829.968	7.569.962
Total		36.857.813	40.401.557

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
US Mid-Cap Value Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	13.584.278	14.772.580
Goldman Sachs International	États-Unis	2.172.104	2.333.073
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	5.387.731	5.904.527
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	549.843	624.425
UBS AG	Suisse	7.747.854	8.511.288
Total		29.441.810	32.145.893
US Sustainable Equity Fund (en USD)			
The Bank of Nova Scotia	Canada	221.285	238.166
Total		221.285	238.166
World Energy Fund (en USD)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	21.117.961	22.543.696
BNP Paribas SA	France	24.347.264	27.174.574
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	24.488.791	28.297.045
Credit Suisse International	Royaume-Uni	877.783	936.828
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	531.650	597.593
Societe Generale SA	France	42.623.820	48.031.346
UBS AG	Suisse	35.812.791	40.350.823
Total		149.800.060	167.931.905
World Financials Fund (en USD)			
BNP Paribas SA	France	51.426.680	55.840.521
Goldman Sachs International	États-Unis	809.446	868.114
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	3.139.530	3.360.905
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	8.085.588	8.847.734
The Bank of Nova Scotia	Canada	2.624.552	2.794.066
UBS AG	Suisse	13.769.293	15.103.121
Total		79.855.089	86.814.461
World Gold Fund (en USD)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	146.999.565	152.562.780
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	41.095.073	46.166.067
Credit Suisse AG	Suisse	10.426	10.782
Goldman Sachs International	États-Unis	96.698.152	103.568.021
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	301	321
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	32.332.633	35.332.965
Macquarie Bank Limited	Australie	10.440.010	11.423.073
Societe Generale SA	France	48.610.934	53.255.661
Total		376.187.094	402.319.670
World Healthscience Fund (en USD)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	24.806.053	25.893.413
BNP Paribas SA	France	312.158.219	340.487.111
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	488.191	551.597
Goldman Sachs International	États-Unis	10.757.603	11.588.363
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	55.813.781	60.013.742
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.169.577	1.285.484
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	9.044.058	10.493.557
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	9.340.311	10.638.057
Societe Generale SA	France	15.456.381	17.030.942
The Bank of Nova Scotia	Canada	6.159.013	6.585.828
UBS AG	Suisse	25.067.398	27.617.349
Total		470.260.585	512.185.443

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Montant en prêt	Garantie reçue
World Mining Fund (en USD)			
Barclays Bank Plc	Royaume-Uni	11.367.104	12.305.065
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	4.752.192	4.907.572
BNP Paribas SA	France	77.543.845	83.696.357
Credit Suisse AG	Suisse	14.154	14.564
Credit Suisse International	Royaume-Uni	110.884	114.483
Goldman Sachs International	États-Unis	120.547.555	128.471.268
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	4.735.440	5.037.448
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	22.523.780	24.491.783
Macquarie Bank Limited	Australie	20.701.111	22.538.003
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	1.566.855	1.798.578
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	23.240.750	26.187.383
Societe Generale SA	France	176.464.365	192.366.257
UBS AG	Suisse	41.441.004	45.169.365
Total		505.009.039	547.098.126
World Real Estate Securities Fund (en USD)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	1.189.518	1.240.148
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	1.304.010	1.471.580
Goldman Sachs International	États-Unis	1.298.947	1.397.554
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.265.390	1.389.100
Macquarie Bank Limited	Australie	3.745.369	4.116.672
Societe Generale SA	France	842.960	927.703
The Bank of Nova Scotia	Canada	4.410.453	4.710.349
UBS AG	Suisse	3.476.502	3.825.480
Total		17.533.149	19.078.586
World Technology Fund (en USD)			
Barclays Capital Securities Limited	Royaume-Uni	17.450.384	18.122.954
BNP Paribas SA	France	435.810.238	472.961.041
Citigroup Global Markets Limited	Royaume-Uni	5.626.853	6.325.431
Credit Suisse AG	Suisse	6.217	6.433
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	75.398.224	80.660.839
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	50.865.975	55.623.433
Merrill Lynch International	Royaume-Uni	15.381.900	17.756.679
Societe Generale SA	France	56.520.993	61.963.083
UBS AG	Suisse	20.365.399	22.323.280
Total		677.426.183	735.743.173

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Swaps sur rendement total (« TRS ») (y compris les CFD)

Tous les TRS (y compris les CFD) sont conclus par les Compartiments en vertu d'un contrat-cadre International Swaps and Derivatives Associations, Inc. (« Contrat-cadre ISDA ») ou d'un contrat similaire. Un Contrat-cadre ISDA est un contrat bilatéral entre les Compartiments et une contrepartie, qui régit les IFD de gré à gré (y compris les TRS et les CFD) conclus par les parties. Les expositions des parties en vertu du Contrat-cadre ISDA sont compensées et garanties ensemble, si bien que toutes informations fournies sur la garantie concernent tous les IFD de gré à gré conclus par les Compartiments en vertu du Contrat-cadre ISDA, et non uniquement les TRS et les CFD.

Toute garantie reçue/fournie par les Compartiments en vertu du Contrat-cadre ISDA est transférée de façon bilatérale en vertu d'un accord de transfert de propriété.

Le tableau suivant indique la valeur des TRS (y compris les CFD) en tant que pourcentage de la VL du Compartiment, au 31 août 2023, et les revenus/rendements perçus pour la période close le 31 août 2023. La valeur des TRS (y compris les CFD) est calculée en fonction de la valeur d'exposition sous-jacente sur une base absolue brute.

Compartiment	Devise	% de la VNI	Total des gains réalisés
Asian Dragon Fund	USD	0,05	1.063.618
Asian Growth Leaders Fund	USD	–	850.068
Asian Sustainable Equity Fund	USD	–	14.276
China Flexible Equity Fund	USD	0,45	(7.224)
China Fund	USD	0,92	(30.695.482)
Continental European Flexible Fund	EUR	0,46	1.354.418
Dynamic High Income Fund	USD	0,07	340.310
Emerging Markets Equity Income Fund	USD	1,48	1.095.189
Emerging Markets Fund	USD	5,19	2.945.801
Emerging Markets Sustainable Equity Fund	USD	0,55	23.619
ESG Global Multi-Asset Income Fund	USD	0,01	(1.187)
ESG Multi-Asset Fund	EUR	3,19	(61.756.821)
Fixed Income Global Opportunities Fund	USD	2,67	(20.803.258)
Global Allocation Fund	USD	4,00	(57.597.952)
Global Corporate Bond Fund	USD	0,87	(140.775)
Global Dynamic Equity Fund	USD	0,56	(14.397)
Global High Yield Bond Fund	USD	–	(3.026.871)
Global Multi-Asset Income Fund	USD	0,06	872.568
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	EUR	1,82	(1.406.460)
Sustainable Global Bond Income Fund	USD	5,75	(192.104)
Sustainable World Bond Fund ⁽⁴⁾	USD	–	(2.053.228)
US Dollar Bond Fund	USD	0,78	44.451
US Dollar High Yield Bond Fund	USD	1,82	(10.208.130)
World Financials Fund	USD	–	6.887.529
World Real Estate Securities Fund	USD	1,11	(18.146)

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Les rendements totaux générés par les TRS (y compris les CFD) sont présentés sur la base du rendement total, y compris les revenus ou charges d'intérêts et de dividendes connexes et les gains/pertes nets provenant des fluctuations de prix de la juste valeur. Tous les rendements et les coûts des TRS (y compris les CFD) sont comptabilisés au profit des Compartiments et ne sont soumis à aucun accord de partage des rendements et des coûts avec la Société de Gestion du Compartiment ou toute autre tierce partie.

Le tableau suivant détaille la valeur d'exposition sous-jacente pour les TRS (y compris les CFD), analysée par contrepartie au 31 août 2023.

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Exposition sous-jacente
Asian Dragon Fund (en USD)		
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	360.363
Total		360.363
China Flexible Equity Fund (en USD)		
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	97.795
Total		97.795
China Fund (en USD)		
Goldman Sachs International	États-Unis	7.584.585
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.775.695
Total		9.360.280

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Exposition sous-jacente
Continental European Flexible Fund (en EUR)		
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	10.720.950
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	13.775.912
Total		24.496.862
Dynamic High Income Fund (en USD)		
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.829.657
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	231.613
Total		2.061.270
Emerging Markets Equity Income Fund (en USD)		
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	2.278.500
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	754.155
Total		3.032.655
Emerging Markets Fund (en USD)		
Goldman Sachs International	États-Unis	80.730.774
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	33.580.840
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	15.497.576
Total		129.809.190
Emerging Markets Sustainable Equity Fund (en USD)		
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	428.401
Total		428.401
ESG Global Multi-Asset Income Fund (en USD)		
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	12.613
Total		12.613
ESG Multi-Asset Fund (en EUR)		
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	193.326.877
Total		193.326.877
Fixed Income Global Opportunities Fund (en USD)		
Bank of America	États-Unis	915.739
BNP Paribas SA	France	52.456.574
Citibank NA	États-Unis	2.585.652
Goldman Sachs International	États-Unis	18.469.444
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	1.753.436
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	78.035.604
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	39.005.466
Total		193.221.915
Global Allocation Fund (en USD)		
Citibank NA	États-Unis	164.997.351
Goldman Sachs International	États-Unis	31.246.952
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	347.370.097
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	35.286.043
Total		578.900.443
Global Corporate Bond Fund (en USD)		
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	7.624.936
Total		7.624.936
Global Dynamic Equity Fund (en USD)		
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	2.310.210
Total		2.310.210
Global Multi-Asset Income Fund (en USD)		
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	2.324.898
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	573.584
Total		2.898.482
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (en EUR)		
BNP Paribas SA	France	1.086.416
Citibank NA	États-Unis	120.561
Goldman Sachs International	États-Unis	558.877
HSBC Bank Plc	Royaume-Uni	153.301
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	4.790.642
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.537.143
Total		9.246.940

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Contrepartie	Pays d'établissement de la contrepartie	Exposition sous-jacente
Sustainable Global Bond Income Fund (en USD)		
BNP Paribas SA	France	2.505.558
Goldman Sachs International	États-Unis	2.703.729
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	1.198.390
Total		6.407.677
US Dollar Bond Fund (en USD)		
Goldman Sachs International	États-Unis	4.337.074
Total		4.337.074
US Dollar High Yield Bond Fund (en USD)		
J.P. Morgan Securities Plc	Royaume-Uni	10.813.373
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	23.518.292
Total		34.331.665
World Real Estate Securities Fund (en USD)		
Morgan Stanley & Co. International Plc	Royaume-Uni	2.203.745
Total		2.203.745

Le tableau suivant fournit une analyse de l'échéance des TRS (y compris les CFD), au 31 août 2023.

	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
Asian Dragon Fund (en USD)							
Asian Dragon Fund	-	-	-	-	-	360.363	360.363
China Flexible Equity Fund (en USD)							
China Flexible Equity Fund	-	-	-	-	-	97.795	97.795
China Fund (en USD)							
China Fund	-	-	-	-	-	9.360.280	9.360.280
Continental European Flexible Fund (en EUR)							
Continental European Flexible Fund	-	-	-	-	-	24.496.862	24.496.862
Dynamic High Income Fund (en USD)							
Dynamic High Income Fund	-	-	-	-	-	2.061.270	2.061.270
Emerging Markets Equity Income Fund (en USD)							
Emerging Markets Equity Income Fund	-	-	-	-	-	3.032.655	3.032.655
Emerging Markets Fund (en USD)							
Emerging Markets Fund	-	-	-	-	-	129.809.190	129.809.190
Emerging Markets Sustainable Equity Fund (en USD)							
Emerging Markets Sustainable Equity Fund	-	-	-	-	-	428.401	428.401
ESG Global Multi-Asset Income Fund (en USD)							
ESG Global Multi-Asset Income Fund	-	-	-	-	-	12.613	12.613
ESG Multi-Asset Fund (en EUR)							
ESG Multi-Asset Fund	-	-	-	193.326.877	-	-	193.326.877
Fixed Income Global Opportunities Fund (en USD)							
Fixed Income Global Opportunities Fund	287.908	190.264.832	-	-	-	2.669.175	193.221.915
Global Allocation Fund (en USD)							
Global Allocation Fund	-	163.912.457	-	-	-	414.987.986	578.900.443
Global Corporate Bond Fund (en USD)							
Global Corporate Bond Fund	-	7.624.936	-	-	-	-	7.624.936
Global Dynamic Equity Fund (en USD)							
Global Dynamic Equity Fund	-	-	-	-	-	2.310.210	2.310.210
Global Multi-Asset Income Fund (en USD)							
Global Multi-Asset Income Fund	-	-	-	-	-	2.898.482	2.898.482
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (en EUR)							
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	19.629	9.074.010	-	-	-	153.301	9.246.940
Sustainable Global Bond Income Fund (en USD)							
Sustainable Global Bond Income Fund	-	6.407.677	-	-	-	-	6.407.677
US Dollar Bond Fund (en USD)							
US Dollar Bond Fund	-	4.337.074	-	-	-	-	4.337.074

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
US Dollar High Yield Bond Fund (en USD)							
US Dollar High Yield Bond Fund	-	-	-	34.331.665	-	-	34.331.665
World Real Estate Securities Fund (en USD)							
World Real Estate Securities Fund	-	-	-	-	-	2.203.745	2.203.745

L'analyse d'échéance susmentionnée repose sur la date d'échéance contractuelle de la transaction respective. Les transactions ouvertes sont les transactions comportant un droit de retour ou résiliables quotidiennement et incluent des CFD.

Analyse de la devise de la garantie

Les Compartiments engagent des activités qui peuvent exiger de fournir une garantie à la contrepartie (« garantie fournie ») ou de détenir une garantie reçue (« garantie reçue ») d'une contrepartie.

Le tableau suivant présente une analyse par devise des garanties en numéraire et des garanties sous-jacentes autres qu'en numéraire reçues/fournies par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété, en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD de gré à gré (y compris les TRS et les CFD), au 31 août 2023.

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Asian Dragon Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	167	-
CAD	-	-	106.424	-
EUR	-	-	153.131	-
GBP	-	-	5.297	-
ILS	-	-	25.383	-
JPY	-	-	1.185.540	-
NOK	-	-	13.436	-
USD	-	-	6.142.923	-
Total	-	-	7.632.301	-
Asian Growth Leaders Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	6.225.402	-
GBP	-	-	852.606	-
JPY	-	-	429.363	-
USD	-	-	674.990	-
Total	-	-	8.182.361	-
Asian High Yield Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	822.045	-
CAD	-	-	3.627.085	-
DKK	-	-	244.277	-
EUR	-	-	135.618.146	-
GBP	-	-	21.878.154	-
JPY	-	-	472.842	-
NOK	-	-	52.557	-
SEK	-	-	320.003	-
USD	-	-	31.529.489	-
Total	-	-	194.564.598	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Asian Multi-Asset Income Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	73.411	-
CAD	-	-	2.259	-
CHF	-	-	3.455	-
DKK	-	-	43.038	-
EUR	-	-	3.242.158	-
GBP	-	-	536.412	-
JPY	-	-	68.281	-
NOK	-	-	6.897	-
SEK	-	-	9.755	-
USD	-	-	1.926.189	-
Total	-	-	5.911.855	-
Asian Sustainable Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	2.444	-
GBP	-	-	29.313	-
JPY	-	-	18.522	-
USD	-	-	95.308	-
Total	-	-	145.587	-
Asian Tiger Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.362.522	-
CAD	-	-	15.148.003	-
CHF	-	-	4.795.164	-
DKK	-	-	2.313.022	-
EUR	-	-	322.894.703	-
GBP	-	-	37.718.638	-
JPY	-	-	2.215.920	-
NOK	-	-	339.072	-
SEK	-	-	1.268.992	-
USD	-	-	102.607.424	-
Total	-	-	490.663.460	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
China Bond Fund (en CNH)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	8.045.938	-
CAD	-	-	32.277.773	-
DKK	-	-	5.103.051	-
EUR	-	-	656.933.364	-
GBP	-	-	63.013.323	-
JPY	-	-	3.962.072	-
SEK	-	-	814.084	-
USD	-	-	168.552.752	-
Total	-	-	938.702.357	-
China Flexible Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	441	-
DKK	-	-	43.528	-
EUR	-	-	5.841	-
GBP	-	-	23.456	-
NOK	-	-	11	-
SEK	-	-	10.910	-
USD	-	-	389.065	-
Total	-	-	473.252	-
China Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.840	-
BMD	-	-	126	-
CAD	-	-	85.167	-
CHF	-	-	121.498	-
DKK	-	-	658.647	-
EUR	-	-	1.072.429	-
GBP	-	-	2.612.095	-
ILS	-	-	19.045	-
JPY	-	-	23.869.974	-
NOK	-	-	10.203	-
SEK	-	-	212.361	-
USD	-	-	15.924.600	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	44.587.985	-
IFD de gré à gré				
USD	660.000	-	-	-
Total des IFD de gré à gré	660.000	-	-	-
Total	660.000	-	44.587.985	-
China Innovation Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	4.058	-
GBP	-	-	216	-
JPY	-	-	192.548	-
USD	-	-	233.066	-
Total	-	-	429.888	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Circular Economy Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	3.126.982	-
CAD	-	-	526.313	-
CHF	-	-	501.502	-
DKK	-	-	859.507	-
EUR	-	-	29.757.041	-
GBP	-	-	8.682.553	-
JPY	-	-	8.567.569	-
NOK	-	-	4.609	-
SEK	-	-	52.218	-
USD	-	-	104.998.063	-
Total	-	-	157.076.357	-
Climate Action Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	2.589	-
EUR	-	-	37.772	-
GBP	-	-	13.946	-
JPY	-	-	1.068	-
SEK	-	-	26	-
USD	-	-	20.861	-
Total	-	-	76.262	-
Climate Action Multi-Asset Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	26.628	-
EUR	-	-	1.088.523	-
GBP	-	-	250.766	-
JPY	-	-	189.097	-
SEK	-	-	34	-
USD	-	-	552.868	-
Total	-	-	2.107.916	-
Continental European Flexible Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	486.694	-
CAD	-	-	1.042.304	-
CHF	-	-	1.387.438	-
DKK	-	-	2.161.687	-
EUR	-	-	26.049.553	-
GBP	-	-	21.669.006	-
JPY	-	-	42.626.588	-
NOK	-	-	771	-
SEK	-	-	426.947	-
USD	-	-	67.739.706	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	163.590.694	-
IFD de gré à gré				
EUR	1.090.000	-	-	-
Total des IFD de gré à gré	1.090.000	-	-	-
Total	1.090.000	-	163.590.694	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Developed Markets Sustainable Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	7.705	-
GBP	-	-	411	-
JPY	-	-	365.642	-
USD	-	-	442.585	-
Total	-	-	816.343	-
Dynamic High Income Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.356.262	-
CAD	-	-	811.618	-
CHF	-	-	620.266	-
DKK	-	-	3.627.519	-
EUR	-	-	61.811.614	-
GBP	-	-	13.248.279	-
JPY	-	-	7.908.546	-
NOK	-	-	215.832	-
SEK	-	-	855.842	-
USD	-	-	86.525.605	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	176.981.383	-
IFD de gré à gré				
USD	-	(1.060.000)	-	-
Total des IFD de gré à gré	-	(1.060.000)	-	-
Total	-	(1.060.000)	176.981.383	-
Emerging Europe Fund (en EUR)⁽³⁾				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	121.485	-
CAD	-	-	1.130	-
CHF	-	-	27.554	-
DKK	-	-	147.776	-
EUR	-	-	2.549.881	-
GBP	-	-	969.467	-
JPY	-	-	2.048.915	-
NOK	-	-	205	-
SEK	-	-	38.776	-
USD	-	-	2.169.698	-
Total	-	-	8.074.887	-
Emerging Markets Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	332.608	-
CAD	-	-	7.772.020	-
CHF	-	-	2.739.672	-
DKK	-	-	373.930	-
EUR	-	-	103.387.509	-
GBP	-	-	7.250.182	-
JPY	-	-	72.126	-
NOK	-	-	106.620	-
SEK	-	-	35.636	-
USD	-	-	33.013.233	-
Total	-	-	155.083.536	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.763.475	-
CAD	-	-	4.613.506	-
DKK	-	-	444.097	-
EUR	-	-	88.250.815	-
GBP	-	-	9.090.533	-
JPY	-	-	1.348.842	-
NOK	-	-	131.139	-
SEK	-	-	691.696	-
USD	-	-	22.068.406	-
Total	-	-	128.402.509	-
Emerging Markets Equity Income Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	355	-
CHF	-	-	29.190	-
DKK	-	-	73.538	-
EUR	-	-	1.555.675	-
GBP	-	-	977.900	-
JPY	-	-	1.610.849	-
NOK	-	-	9	-
SEK	-	-	20.279	-
USD	-	-	1.326.934	-
Total	-	-	5.594.729	-
Emerging Markets Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	2.054.856	-
BMD	-	-	332	-
CAD	-	-	489.145	-
CHF	-	-	23.444	-
DKK	-	-	202.239	-
EUR	-	-	7.634.385	-
GBP	-	-	2.309.013	-
ILS	-	-	50.333	-
JPY	-	-	4.322.830	-
NOK	-	-	29.694	-
SEK	-	-	75.887	-
USD	-	-	78.340.464	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	95.532.622	-
IFD de gré à gré				
USD	2.470.000	(2.010.000)	-	-
Total des IFD de gré à gré	2.470.000	(2.010.000)	-	-
Total	2.470.000	(2.010.000)	95.532.622	-
Emerging Markets Impact Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	5.547	-
DKK	-	-	3.097	-
EUR	-	-	5.676.679	-
GBP	-	-	1.974.591	-
JPY	-	-	69.425	-
NOK	-	-	48.544	-
SEK	-	-	158.073	-
USD	-	-	2.418.695	-
Total	-	-	10.354.651	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	2.493.732	-
CAD	-	-	1.484.652	-
CHF	-	-	533.449	-
DKK	-	-	1.386.961	-
EUR	-	-	106.057.380	-
GBP	-	-	8.038.722	-
JPY	-	-	1.359.762	-
NOK	-	-	183.102	-
SEK	-	-	4.784	-
USD	-	-	42.328.131	-
Total	-	-	163.870.675	-
Emerging Markets Sustainable Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	13.440	-
GBP	-	-	98.508	-
JPY	-	-	311.215	-
USD	-	-	620.953	-
Total	-	-	1.044.116	-
ESG Flex Choice Cautious Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	19.813	-
EUR	-	-	289.019	-
GBP	-	-	106.710	-
JPY	-	-	8.174	-
SEK	-	-	197	-
USD	-	-	159.623	-
Total	-	-	583.536	-
ESG Flex Choice Growth Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	17.911	-
EUR	-	-	261.271	-
GBP	-	-	96.465	-
JPY	-	-	7.389	-
SEK	-	-	179	-
USD	-	-	144.298	-
Total	-	-	527.513	-
ESG Global Conservative Income Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	494.006	-
CAD	-	-	2.793	-
CHF	-	-	12.697	-
DKK	-	-	72.682	-
EUR	-	-	12.414.532	-
GBP	-	-	1.209.439	-
JPY	-	-	87.077	-
NOK	-	-	47.989	-
SEK	-	-	40.390	-
USD	-	-	4.036.938	-
Total	-	-	18.418.543	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
ESG Global Multi-Asset Income Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	169.259	-
GBP	-	-	145.175	-
JPY	-	-	240.360	-
USD	-	-	588.667	-
Total	-	-	1.143.461	-
ESG Multi-Asset Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	982.210	-
BMD	-	-	877	-
CAD	-	-	2.885.224	-
CHF	-	-	11.018.154	-
DKK	-	-	3.379.135	-
EUR	-	-	112.513.052	-
GBP	-	-	27.743.021	-
ILS	-	-	132.926	-
JPY	-	-	70.304.556	-
NOK	-	-	170.490	-
SEK	-	-	6.766.215	-
USD	-	-	192.007.432	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	427.903.292	-
IFD de gré à gré				
EUR	7.860.000	(7.390.999)	-	-
Total des IFD de gré à gré	7.860.000	(7.390.999)	-	-
Total	7.860.000	(7.390.999)	427.903.292	-
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (en USD)⁽⁴⁾				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	210	-
DKK	-	-	648	-
EUR	-	-	956.772	-
GBP	-	-	294.769	-
NOK	-	-	10.164	-
SEK	-	-	6.185	-
USD	-	-	323.756	-
Total	-	-	1.592.504	-
Euro Bond Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.664.851	-
CAD	-	-	19.316.747	-
CHF	-	-	305.185	-
DKK	-	-	2.048.964	-
EUR	-	-	174.357.414	-
GBP	-	-	24.845.145	-
JPY	-	-	30.782.165	-
NOK	-	-	196.754	-
SEK	-	-	2.118.321	-
USD	-	-	78.814.431	-
Total	-	-	334.449.977	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Euro Corporate Bond Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	730.945	-
CAD	-	-	301.719	-
CHF	-	-	3.119.423	-
DKK	-	-	1.160.622	-
EUR	-	-	80.701.723	-
GBP	-	-	8.944.212	-
JPY	-	-	1.345.616	-
NOK	-	-	121.101	-
SEK	-	-	375.643	-
USD	-	-	41.547.602	-
Total	-	-	138.348.606	-
Euro Short Duration Bond Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	2.704.816	-
CAD	-	-	121.355.021	-
CHF	-	-	56.849.486	-
DKK	-	-	373.900	-
EUR	-	-	368.618.982	-
GBP	-	-	156.472.929	-
JPY	-	-	143.626.176	-
NOK	-	-	4.358.226	-
SEK	-	-	1.066.884	-
USD	-	-	187.739.708	-
Total	-	-	1.043.166.128	-
Euro-Markets Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	4.060.577	-
CAD	-	-	238.340	-
CHF	-	-	168.459	-
DKK	-	-	1.278.390	-
EUR	-	-	35.863.454	-
GBP	-	-	9.756.027	-
JPY	-	-	6.920.674	-
NOK	-	-	6.196	-
SEK	-	-	273.669	-
USD	-	-	26.594.200	-
Total	-	-	85.159.986	-
European Equity Income Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	89.004	-
CAD	-	-	102.936	-
CHF	-	-	394.883	-
DKK	-	-	2.896.724	-
EUR	-	-	11.377.045	-
GBP	-	-	4.714.209	-
JPY	-	-	4.153.022	-
NOK	-	-	696	-
SEK	-	-	600.405	-
USD	-	-	32.117.050	-
Total	-	-	56.445.974	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
European Focus Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	12.674	-
CHF	-	-	77.461	-
DKK	-	-	722.311	-
EUR	-	-	1.299.882	-
GBP	-	-	1.145.160	-
JPY	-	-	2.939.906	-
NOK	-	-	149	-
SEK	-	-	166.902	-
USD	-	-	10.281.583	-
Total	-	-	16.646.028	-
European Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	270.086	-
CHF	-	-	647.346	-
DKK	-	-	854.891	-
EUR	-	-	12.708.340	-
GBP	-	-	14.576.983	-
JPY	-	-	35.844.564	-
SEK	-	-	255.495	-
USD	-	-	15.445.267	-
Total	-	-	80.602.972	-
European High Yield Bond Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	611.286	-
CAD	-	-	132.876	-
DKK	-	-	175.070	-
EUR	-	-	27.356.974	-
GBP	-	-	3.093.325	-
JPY	-	-	168.278	-
NOK	-	-	31.482	-
SEK	-	-	96.663	-
USD	-	-	8.721.948	-
Total	-	-	40.387.902	-
European Special Situations Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	41.863	-
CHF	-	-	644.714	-
DKK	-	-	856.386	-
EUR	-	-	7.823.490	-
GBP	-	-	12.664.065	-
JPY	-	-	41.235.487	-
SEK	-	-	238.847	-
USD	-	-	23.436.588	-
Total	-	-	86.941.440	-
European Sustainable Equity Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CHF	-	-	994	-
DKK	-	-	1.312	-
EUR	-	-	228.655	-
GBP	-	-	49.602	-
JPY	-	-	62.454	-
SEK	-	-	392	-
USD	-	-	14.695	-
Total	-	-	358.104	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
European Value Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	2.445	-
CHF	-	-	101.694	-
DKK	-	-	389.821	-
EUR	-	-	1.218.199	-
GBP	-	-	478.378	-
JPY	-	-	1.123.573	-
NOK	-	-	59	-
SEK	-	-	60.439	-
USD	-	-	5.727.178	-
Total	-	-	9.101.786	-
FinTech Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	492.879	-
DKK	-	-	835.250	-
EUR	-	-	1.614.980	-
GBP	-	-	1.118.640	-
JPY	-	-	4.887.785	-
NOK	-	-	203	-
SEK	-	-	209.413	-
USD	-	-	14.384.155	-
Total	-	-	23.543.305	-
Fixed Income Global Opportunities Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	26.398.197	-
BMD	-	-	3	-
CAD	-	-	28.661.715	-
CHF	-	-	103.973.777	-
DKK	-	-	3.137.336	-
EUR	-	-	364.979.347	-
GBP	-	-	57.785.845	-
ILS	-	-	463	-
JPY	-	-	301.824.969	-
NOK	-	-	139.816	-
SEK	-	-	12.430.437	-
USD	-	-	494.967.252	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	1.394.299.157	-
IFD de gré à gré				
AUD	-	(79.897)	-	-
CAD	134.971	-	-	-
CHF	25.120	-	-	-
CZK	135.866	-	-	-
EUR	1.983.381	(4.462.493)	-	-
GBP	11.781.805	-	-	-
JPY	-	(38.145)	-	-
MXN	2.711.520	-	-	-
NZD	249.459	-	-	-
PLN	386.863	-	-	-
USD	157.366.934	(29.062.500)	-	893.649
ZAR	-	(196.992)	-	-
Total des IFD de gré à gré	174.775.919	(33.840.027)	-	893.649
Total	174.775.919	(33.840.027)	1.394.299.157	893.649

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Future Consumer Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	9.475	-
GBP	-	-	506	-
JPY	-	-	449.610	-
USD	-	-	544.222	-
Total	-	-	1.003.813	-
Future Of Transport Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	1.158.151	-
CHF	-	-	377.394	-
DKK	-	-	551.753	-
EUR	-	-	21.196.609	-
GBP	-	-	10.458.628	-
JPY	-	-	14.715.899	-
SEK	-	-	6.892	-
USD	-	-	43.401.607	-
Total	-	-	91.866.933	-
Global Allocation Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	3.866.536	-
BMD	-	-	5.905	-
CAD	-	-	142.279.545	-
CHF	-	-	158.049.244	-
DKK	-	-	32.166.700	-
EUR	-	-	640.786.030	-
GBP	-	-	173.706.754	-
ILS	-	-	895.253	-
JPY	-	-	109.497.457	-
NOK	-	-	586.181	-
SEK	-	-	25.960.920	-
USD	-	-	1.239.698.946	-
Total	-	-	2.527.499.471	-
IFD de gré à gré				
EUR	1.377.103	(1.005.448)	-	-
GBP	135.819	-	-	-
MXN	1.718.846	-	-	-
USD	14.183.000	(5.161.464)	-	523.375.136
ZAR	-	(635.097)	-	-
Total des IFD de gré à gré	17.414.768	(6.802.009)	-	523.375.136
Total	17.414.768	(6.802.009)	2.527.499.471	523.375.136

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Global Corporate Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	216.881	-
CAD	-	-	1.045.448	-
CHF	-	-	255.132	-
DKK	-	-	346.485	-
EUR	-	-	18.839.318	-
GBP	-	-	2.440.204	-
JPY	-	-	306.510	-
NOK	-	-	13.287	-
SEK	-	-	247.999	-
USD	-	-	7.823.476	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	31.534.740	-
IFD de gré à gré				
CAD	981.594	-	-	-
CHF	264.790	-	-	-
EUR	564.114	(214.057)	-	-
USD	2.416.000	(869.495)	-	-
Total des IFD de gré à gré	4.226.498	(1.083.552)	-	-
Total	4.226.498	(1.083.552)	31.534.740	-
Global Dynamic Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	251	-
CAD	-	-	815.928	-
CHF	-	-	351.261	-
DKK	-	-	467.279	-
EUR	-	-	6.756.013	-
GBP	-	-	2.218.544	-
ILS	-	-	38.114	-
JPY	-	-	5.545.168	-
NOK	-	-	20.197	-
SEK	-	-	126.600	-
USD	-	-	25.430.648	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	41.770.003	-
IFD de gré à gré				
USD	-	-	-	21.483.020
Total des IFD de gré à gré	-	-	-	21.483.020
Total	-	-	41.770.003	21.483.020
Global Equity Income Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	27.091	-
EUR	-	-	476.695	-
GBP	-	-	4.239.653	-
JPY	-	-	4.871.699	-
USD	-	-	18.712.829	-
Total	-	-	28.327.967	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Global Government Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.168.574	-
CAD	-	-	9.178.186	-
CHF	-	-	372.352	-
DKK	-	-	657.700	-
EUR	-	-	52.782.173	-
GBP	-	-	10.719.159	-
JPY	-	-	12.921.678	-
NOK	-	-	22.098	-
SEK	-	-	608.521	-
USD	-	-	26.009.638	-
Total	-	-	114.440.079	-
Global High Yield Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.639.141	-
CAD	-	-	160.700	-
CHF	-	-	324.682	-
DKK	-	-	705.927	-
EUR	-	-	74.624.805	-
GBP	-	-	13.345.796	-
JPY	-	-	2.014.134	-
NOK	-	-	149.181	-
SEK	-	-	583.652	-
USD	-	-	32.838.239	-
Total	-	-	126.386.257	-
Global Inflation Linked Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CHF	-	-	1.178.521	-
DKK	-	-	5.426	-
EUR	-	-	6.287.652	-
GBP	-	-	1.507.069	-
JPY	-	-	6.224.402	-
NOK	-	-	218	-
SEK	-	-	27.357	-
USD	-	-	991.450	-
Total	-	-	16.222.095	-
Global Long-Horizon Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	1.024.447	-
DKK	-	-	200.066	-
EUR	-	-	14.941.008	-
GBP	-	-	5.614.356	-
JPY	-	-	421.788	-
NOK	-	-	49	-
SEK	-	-	60.333	-
USD	-	-	10.025.241	-
Total	-	-	32.287.288	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Global Multi-Asset Income Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	6.060.576	-
CAD	-	-	1.704.634	-
CHF	-	-	91.834	-
DKK	-	-	1.681.655	-
EUR	-	-	86.970.585	-
GBP	-	-	20.487.425	-
JPY	-	-	16.562.092	-
NOK	-	-	180.621	-
SEK	-	-	419.660	-
USD	-	-	80.023.470	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	214.182.552	-
IFD de gré à gré				
USD	641.821	(1.810.000)	-	-
Total des IFD de gré à gré	641.821	(1.810.000)	-	-
Total	641.821	(1.810.000)	214.182.552	-
Impact Bond Fund (en EUR)⁽²⁾				
Opérations de prêts de titres				
DKK	-	-	1.354	-
EUR	-	-	930.968	-
GBP	-	-	147.089	-
NOK	-	-	42.984	-
SEK	-	-	328	-
USD	-	-	88.820	-
Total	-	-	1.211.543	-
Japan Flexible Equity Fund (en JPY)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	913.692.775	-
CHF	-	-	70.100.063	-
DKK	-	-	221.393.791	-
EUR	-	-	4.107.116.390	-
GBP	-	-	411.753.089	-
JPY	-	-	1.024.771.421	-
NOK	-	-	29.110	-
SEK	-	-	51.607.678	-
USD	-	-	6.389.682.730	-
Total	-	-	13.190.147.047	-
Japan Small & MidCap Opportunities Fund (en JPY)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	125.794.935	-
CAD	-	-	445.991.338	-
CHF	-	-	25.965.817	-
DKK	-	-	65.555.527	-
EUR	-	-	2.183.604.360	-
GBP	-	-	228.852.307	-
JPY	-	-	599.556.962	-
NOK	-	-	190.914	-
SEK	-	-	12.023.344	-
USD	-	-	2.367.438.160	-
Total	-	-	6.054.973.664	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Latin American Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	621	-
CAD	-	-	416.036	-
DKK	-	-	2.065.870	-
EUR	-	-	904.993	-
GBP	-	-	1.133.179	-
ILS	-	-	94.232	-
JPY	-	-	4.646.612	-
NOK	-	-	50.384	-
SEK	-	-	517.779	-
USD	-	-	51.096.547	-
Total	-	-	60.926.253	-
Natural Resources Fund (en USD)⁽⁷⁾				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	155.028	-
CHF	-	-	28.649	-
DKK	-	-	1.427.925	-
EUR	-	-	4.113.238	-
GBP	-	-	2.282.269	-
JPY	-	-	3.536.929	-
NOK	-	-	338	-
SEK	-	-	361.106	-
USD	-	-	23.206.206	-
Total	-	-	35.111.688	-
Next Generation Health Care Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	12.848	-
DKK	-	-	73.204	-
EUR	-	-	151.743	-
GBP	-	-	67.380	-
JPY	-	-	485.039	-
NOK	-	-	18	-
SEK	-	-	18.347	-
USD	-	-	1.254.210	-
Total	-	-	2.062.789	-
Next Generation Technology Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	6.381.422	-
CAD	-	-	7.006.693	-
CHF	-	-	379.715	-
DKK	-	-	2.150.531	-
EUR	-	-	105.363.085	-
GBP	-	-	23.175.446	-
JPY	-	-	53.648.387	-
NOK	-	-	9.730	-
SEK	-	-	418.920	-
USD	-	-	116.504.503	-
Total	-	-	315.038.432	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Nutrition Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	150.657	-
BMD	-	-	575	-
CAD	-	-	577.886	-
CHF	-	-	42.508	-
DKK	-	-	108.831	-
EUR	-	-	6.141.254	-
GBP	-	-	3.340.275	-
ILS	-	-	87.187	-
JPY	-	-	4.024.350	-
NOK	-	-	46.385	-
SEK	-	-	32.079	-
USD	-	-	23.533.318	-
Total	-	-	38.085.305	-
Sustainable Asian Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	5.743	-
EUR	-	-	10.331.029	-
GBP	-	-	1.322.053	-
JPY	-	-	380.489	-
SEK	-	-	101.145	-
USD	-	-	2.880.193	-
Total	-	-	15.020.652	-
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	175.805	-
CAD	-	-	1.006	-
DKK	-	-	20.394	-
EUR	-	-	5.461.503	-
GBP	-	-	558.376	-
JPY	-	-	19.861	-
NOK	-	-	8.051	-
SEK	-	-	11.028	-
USD	-	-	1.633.273	-
Total	-	-	7.889.297	-
Sustainable Emerging Markets Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	334.617	-
CAD	-	-	8.371	-
DKK	-	-	283.998	-
EUR	-	-	14.755.538	-
GBP	-	-	1.621.317	-
JPY	-	-	282.155	-
NOK	-	-	28.190	-
SEK	-	-	684	-
USD	-	-	6.031.639	-
Total	-	-	23.346.509	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	220.986	-
CAD	-	-	3.646	-
DKK	-	-	18.615	-
EUR	-	-	5.714.685	-
GBP	-	-	1.147.087	-
JPY	-	-	16.874	-
NOK	-	-	26.913	-
SEK	-	-	74.316	-
USD	-	-	1.825.353	-
Total	-	-	9.048.475	-
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	808.511	-
CAD	-	-	5.132	-
DKK	-	-	236.246	-
EUR	-	-	32.582.831	-
GBP	-	-	4.191.858	-
JPY	-	-	227.583	-
NOK	-	-	134.325	-
SEK	-	-	3.258	-
USD	-	-	11.086.302	-
Total	-	-	49.276.046	-
Sustainable Energy Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	16.373	-
BMD	-	-	3.204	-
CAD	-	-	6.082.893	-
CHF	-	-	1.126.383	-
DKK	-	-	2.460.892	-
EUR	-	-	34.172.714	-
GBP	-	-	25.749.188	-
ILS	-	-	485.804	-
JPY	-	-	45.559.093	-
NOK	-	-	257.392	-
SEK	-	-	356.819	-
USD	-	-	253.582.572	-
Total	-	-	369.853.327	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (en EUR)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	439.750	-
CAD	-	-	633.501	-
CHF	-	-	253	-
DKK	-	-	131.096	-
EUR	-	-	8.324.348	-
GBP	-	-	1.644.513	-
JPY	-	-	431.508	-
NOK	-	-	28.734	-
SEK	-	-	94.950	-
USD	-	-	3.867.356	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	15.596.009	-
IFD de gré à gré				
AUD	-	(4.908)	-	-
CHF	1.908	-	-	-
CZK	11.362	-	-	-
EUR	3.355.302	(1.836.165)	-	1.184.764
GBP	788.398	-	-	-
JPY	-	(9.472)	-	-
MXN	472.712	-	-	-
NZD	15.085	-	-	-
PLN	29.375	-	-	-
USD	5.992.086	-	-	-
ZAR	-	(12.359)	-	-
Total des IFD de gré à gré	10.666.228	(1.862.904)	-	1.184.764
Total	10.666.228	(1.862.904)	15.596.009	1.184.764
Sustainable Global Bond Income Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	110.249	-
CAD	-	-	1.199	-
DKK	-	-	18.993	-
EUR	-	-	3.484.088	-
GBP	-	-	664.237	-
JPY	-	-	18.069	-
NOK	-	-	14.292	-
SEK	-	-	22.736	-
USD	-	-	1.234.790	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	5.568.653	-
IFD de gré à gré				
EUR	-	(19.688)	-	-
MXN	67.076	-	-	-
USD	432.929	-	-	-
ZAR	1.294	-	-	-
Total des IFD de gré à gré	501.299	(19.688)	-	-
Total	501.299	(19.688)	5.568.653	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Sustainable Global Infrastructure Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	5.360	-
EUR	-	-	636.948	-
GBP	-	-	85.146	-
JPY	-	-	56.280	-
USD	-	-	480.291	-
Total	-	-	1.264.025	-
Sustainable World Bond Fund (en USD)⁽⁴⁾				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	299.018	-
CAD	-	-	4.771.272	-
CHF	-	-	1.102.677	-
DKK	-	-	1.814.446	-
EUR	-	-	42.439.470	-
GBP	-	-	7.058.225	-
JPY	-	-	738.545	-
NOK	-	-	300.788	-
SEK	-	-	452.723	-
USD	-	-	23.013.996	-
Total	-	-	81.991.160	-
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (en CHF)⁽⁵⁾				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	36.937	-
CAD	-	-	2.112.750	-
CHF	-	-	354.685	-
DKK	-	-	2.298.574	-
EUR	-	-	10.411.227	-
GBP	-	-	9.399.669	-
JPY	-	-	15.308.391	-
NOK	-	-	496	-
SEK	-	-	636.938	-
USD	-	-	36.768.294	-
Total	-	-	77.327.961	-
Systematic Global Equity High Income Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.207.617	-
BMD	-	-	3.692	-
CAD	-	-	3.616.276	-
CHF	-	-	1.722.579	-
DKK	-	-	3.476.518	-
EUR	-	-	37.428.750	-
GBP	-	-	23.293.502	-
ILS	-	-	559.833	-
JPY	-	-	27.902.499	-
NOK	-	-	298.354	-
SEK	-	-	1.016.045	-
USD	-	-	272.100.347	-
Total	-	-	372.626.012	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund (en USD)⁽²⁾				
Opérations de prêts de titres				
EUR	-	-	1.832	-
GBP	-	-	21.978	-
JPY	-	-	13.887	-
USD	-	-	71.457	-
Total	-	-	109.154	-
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund (en USD)⁽⁴⁾				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	210.214	-
BMD	-	-	422	-
CAD	-	-	2.315.367	-
CHF	-	-	136.861	-
DKK	-	-	910.156	-
EUR	-	-	9.811.935	-
GBP	-	-	2.302.083	-
ILS	-	-	63.995	-
JPY	-	-	8.586.943	-
NOK	-	-	34.358	-
SEK	-	-	200.914	-
USD	-	-	33.524.259	-
Total	-	-	58.097.507	-
United Kingdom Fund (en GBP)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	138	-
CAD	-	-	101.660	-
DKK	-	-	14.850	-
EUR	-	-	166.141	-
GBP	-	-	82.956	-
ILS	-	-	20.995	-
JPY	-	-	1.240.103	-
NOK	-	-	11.117	-
SEK	-	-	3.722	-
USD	-	-	5.864.496	-
Total	-	-	7.506.178	-
US Basic Value Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	1.794	-
CAD	-	-	1.918.565	-
CHF	-	-	108.299	-
DKK	-	-	930.425	-
EUR	-	-	5.773.873	-
GBP	-	-	1.048.002	-
ILS	-	-	272.004	-
JPY	-	-	8.983.572	-
NOK	-	-	144.173	-
SEK	-	-	194.440	-
USD	-	-	71.591.574	-
Total	-	-	90.966.721	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
US Dollar Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	136.087	-
CAD	-	-	72.214	-
CHF	-	-	211.944	-
DKK	-	-	77.784	-
EUR	-	-	3.336.962	-
GBP	-	-	361.155	-
JPY	-	-	1.962.777	-
NOK	-	-	85	-
SEK	-	-	5.491	-
USD	-	-	2.659.152	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	8.823.651	-
IFD de gré à gré				
CAD	16.260	-	-	-
CZK	2.380	-	-	-
EUR	18.938	(4.631)	-	-
GBP	-	(2.917)	-	-
JPY	39.468	-	-	-
MXN	7.147	-	-	-
PLN	6.186	-	-	-
USD	489.671	(320.000)	615.101	21.209
ZAR	2.559	-	-	-
Total des IFD de gré à gré	582.609	(327.548)	615.101	21.209
Total	582.609	(327.548)	9.438.752	21.209
US Dollar High Yield Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	1.006.201	-
CAD	-	-	511.521	-
CHF	-	-	514.333	-
DKK	-	-	1.524.550	-
EUR	-	-	61.043.971	-
GBP	-	-	9.426.897	-
JPY	-	-	3.901.076	-
NOK	-	-	222.635	-
SEK	-	-	478.162	-
USD	-	-	34.415.525	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	113.044.871	-
IFD de gré à gré				
USD	1.677.000	(1.322.390)	-	-
Total des IFD de gré à gré	1.677.000	(1.322.390)	-	-
Total	1.677.000	(1.322.390)	113.044.871	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
US Dollar Short Duration Bond Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	54.358	-
CAD	-	-	157.624	-
CHF	-	-	2.530.348	-
DKK	-	-	613.942	-
EUR	-	-	68.258.461	-
GBP	-	-	11.618.746	-
JPY	-	-	7.809.450	-
NOK	-	-	3.974	-
SEK	-	-	2.737.885	-
USD	-	-	47.624.745	-
Total	-	-	141.409.533	-
US Flexible Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	3.528	-
CAD	-	-	2.256.911	-
DKK	-	-	1.407.595	-
EUR	-	-	3.214.645	-
GBP	-	-	2.629.982	-
ILS	-	-	534.885	-
JPY	-	-	9.525.444	-
NOK	-	-	283.482	-
SEK	-	-	352.792	-
USD	-	-	127.742.031	-
Total	-	-	147.951.295	-
US Growth Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	896	-
CAD	-	-	580.699	-
EUR	-	-	876.081	-
GBP	-	-	1.089.470	-
ILS	-	-	135.894	-
JPY	-	-	4.082.839	-
NOK	-	-	71.935	-
USD	-	-	33.563.743	-
Total	-	-	40.401.557	-
US Mid-Cap Value Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	499	-
CAD	-	-	399.603	-
CHF	-	-	7.564	-
DKK	-	-	550.512	-
EUR	-	-	1.664.482	-
GBP	-	-	861.977	-
ILS	-	-	75.638	-
JPY	-	-	4.215.807	-
NOK	-	-	40.170	-
SEK	-	-	139.224	-
USD	-	-	24.190.417	-
Total	-	-	32.145.893	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
US Sustainable Equity Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
CAD	-	-	42.644	-
EUR	-	-	82.367	-
GBP	-	-	44.149	-
USD	-	-	69.006	-
Total	-	-	238.166	-
World Energy Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	4.016.545	-
CAD	-	-	18.062	-
CHF	-	-	749.920	-
DKK	-	-	1.493.661	-
EUR	-	-	48.956.124	-
GBP	-	-	9.535.712	-
JPY	-	-	26.036.491	-
NOK	-	-	5.982	-
SEK	-	-	718.645	-
USD	-	-	76.400.763	-
Total	-	-	167.931.905	-
World Financials Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
BMD	-	-	1.880	-
CAD	-	-	1.733.056	-
DKK	-	-	807.323	-
EUR	-	-	3.130.366	-
GBP	-	-	1.825.577	-
ILS	-	-	284.979	-
JPY	-	-	7.203.473	-
NOK	-	-	151.049	-
SEK	-	-	202.628	-
USD	-	-	71.474.130	-
Total	-	-	86.814.461	-
World Gold Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	27.970.601	-
CAD	-	-	3.495.208	-
CHF	-	-	1.250.421	-
DKK	-	-	5.073.869	-
EUR	-	-	146.689.235	-
GBP	-	-	47.853.690	-
JPY	-	-	10.204.418	-
NOK	-	-	41.743	-
SEK	-	-	1.554.273	-
USD	-	-	158.186.212	-
Total	-	-	402.319.670	-

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
World Healthscience Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	4.690.760	-
BMD	-	-	9.635	-
CAD	-	-	9.431.951	-
CHF	-	-	149.357	-
DKK	-	-	309.282	-
EUR	-	-	84.499.490	-
GBP	-	-	28.784.970	-
ILS	-	-	1.460.876	-
JPY	-	-	31.050.150	-
NOK	-	-	780.207	-
SEK	-	-	305.150	-
USD	-	-	350.713.615	-
Total	-	-	512.185.443	-
World Mining Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	885.383	-
BMD	-	-	1.496	-
CAD	-	-	5.572.567	-
CHF	-	-	386.937	-
DKK	-	-	2.687.821	-
EUR	-	-	147.617.435	-
GBP	-	-	43.514.284	-
ILS	-	-	226.801	-
JPY	-	-	59.001.904	-
NOK	-	-	121.903	-
SEK	-	-	3.266.976	-
USD	-	-	283.814.619	-
Total	-	-	547.098.126	-
World Real Estate Securities Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	227.571	-
CAD	-	-	897.909	-
CHF	-	-	39.316	-
DKK	-	-	184.896	-
EUR	-	-	3.456.945	-
GBP	-	-	1.502.738	-
JPY	-	-	1.942.166	-
NOK	-	-	364	-
SEK	-	-	44.589	-
USD	-	-	10.782.092	-
Total des opérations de prêts de titres	-	-	19.078.586	-
IFD de gré à gré				
USD	40.000	-	-	-
Total des IFD de gré à gré	40.000	-	-	-
Total	40.000	-	19.078.586	-

Devise	Garantie en numéraire reçue	Garantie en numéraire fournie	Garantie autre qu'en numéraire reçue	Garantie autre qu'en numéraire fournie
World Technology Fund (en USD)				
Opérations de prêts de titres				
AUD	-	-	3.285.629	-
BMD	-	-	12.867	-
CAD	-	-	11.128.817	-
CHF	-	-	185.298	-
DKK	-	-	5.335.157	-
EUR	-	-	122.252.808	-
GBP	-	-	34.871.722	-
ILS	-	-	1.950.843	-
JPY	-	-	31.934.214	-
NOK	-	-	1.038.723	-
SEK	-	-	2.082.047	-
USD	-	-	521.665.048	-
Total	-	-	735.743.173	-

(2) Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(3) Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(4) Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(5) Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(7) Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Réutilisation de la garantie reçue

Au 31 août 2023, toutes les garanties en numéraire reçues par les Compartiments avaient été réinvesties dans des fonds du marché monétaire gérés par la Société de Gestion ou ses affiliés, comme indiqué dans le portefeuille de titres du Compartiment. Les Compartiments sont le propriétaire légal d'une garantie entrante et peuvent vendre les actifs et conserver les liquidités en cas de défaut de paiement. Toutes les liquidités reçues ou fournies en garantie ont une échéance ouverte puisqu'elles ne sont pas soumises à une date d'échéance contractuelle.

Les garanties autres qu'en numéraire, reçues au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD de gré à gré, ne peuvent être vendues, réinvesties ni mises en gage.

Le tableau suivant résume les rendements perçus par les Compartiments au cours de l'exercice clos le 31 août 2023, résultant du réinvestissement dans des fonds du marché monétaire de garanties en numéraire reçues dans le cadre des opérations sur instruments dérivés de gré à gré. Ces rendements représentent le rendement total cumulé du fonds du marché monétaire représentatif pour l'exercice clos le 31 août 2023. Ces rendements ne tiennent pas compte de tout intérêt payable à la contrepartie en vertu des contrats de garantie correspondants.

Fonds du marché monétaire	Rendement total (%)
Institutional Cash Series plc	
- BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	4,34 %
- BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund	2,30 %

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Analyse de la devise, du type, de la qualité et de l'échéance de la garantie

Le tableau suivant présente une analyse du type, de la qualité et de l'échéance des garanties autres qu'en numéraire, reçues et comptabilisées par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD négociés de gré à gré (y compris des TRS et des CFD), au 31 août 2023.

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
Asian Dragon Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	7.632.301	7.632.301
Total	-	-	-	-	-	7.632.301	7.632.301
Asian Growth Leaders Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	8.182.361	8.182.361
Total	-	-	-	-	-	8.182.361	8.182.361
Asian High Yield Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	414	5.873.974	15.321.943	171.670.360	-	192.866.691
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.697.907	1.697.907
Total	-	414	5.873.974	15.321.943	171.670.360	1.697.907	194.564.598
Asian Multi-Asset Income Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	308	144.961	374.459	4.170.426	576	4.690.730
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.221.125	1.221.125
Total	-	308	144.961	374.459	4.170.426	1.221.701	5.911.855
Asian Sustainable Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	6.567	44.567	-	51.134
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	94.453	94.453
Total	-	-	-	6.567	44.567	94.453	145.587
Asian Tiger Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	2.669	18.856.712	34.328.412	399.954.541	-	453.142.334
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	37.521.126	37.521.126
Total	-	2.669	18.856.712	34.328.412	399.954.541	37.521.126	490.663.460
China Bond Fund (en CNH)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	37.259.029	71.854.307	789.965.396	-	899.078.732
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	39.623.625	39.623.625
Total	-	-	37.259.029	71.854.307	789.965.396	39.623.625	938.702.357
China Flexible Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	25.479	-	25.479
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	447.773	447.773
Total	-	-	-	-	25.479	447.773	473.252

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
China Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	733.875	1.191.412	-	1.925.287
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	42.662.698	42.662.698
Total	-	-	-	733.875	1.191.412	42.662.698	44.587.985
China Innovation Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	429.888	429.888
Total	-	-	-	-	-	429.888	429.888
Circular Economy Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	592.362	8.145	175.289	18.943.155	1.343.269	21.062.220
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	136.014.137	136.014.137
Total	-	592.362	8.145	175.289	18.943.155	137.357.406	157.076.357
Climate Action Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	605	2.410	72.016	-	75.031
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.231	1.231
Total	-	-	605	2.410	72.016	1.231	76.262
Climate Action Multi-Asset Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	795	19.988	272.820	-	293.603
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.814.313	1.814.313
Total	-	-	795	19.988	272.820	1.814.313	2.107.916
Continental European Flexible Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	92.197	208.397	5.460.883	32.610.155	209.071	38.580.703
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	125.009.991	125.009.991
Total	-	92.197	208.397	5.460.883	32.610.155	125.219.062	163.590.694
Developed Markets Sustainable Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	816.343	816.343
Total	-	-	-	-	-	816.343	816.343
Dynamic High Income Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	32.331	1.117.130	5.149.594	73.533.261	69.477	79.901.793
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	97.079.590	97.079.590
Total	-	32.331	1.117.130	5.149.594	73.533.261	97.149.067	176.981.383

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
Emerging Europe Fund (en EUR)⁽³⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	23.014	-	167.764	805.240	52.187	1.048.205
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	7.026.682	7.026.682
Total	-	23.014	-	167.764	805.240	7.078.869	8.074.887
Emerging Markets Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	839	6.896.470	12.018.612	124.350.462	-	143.266.383
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	11.817.153	11.817.153
Total	-	839	6.896.470	12.018.612	124.350.462	11.817.153	155.083.536
Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	1.032	3.949.417	7.739.986	112.195.719	-	123.886.154
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	4.516.355	4.516.355
Total	-	1.032	3.949.417	7.739.986	112.195.719	4.516.355	128.402.509
Emerging Markets Equity Income Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	225.381	495.778	-	721.159
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	4.873.570	4.873.570
Total	-	-	-	225.381	495.778	4.873.570	5.594.729
Emerging Markets Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	389.263	-	139.070	11.991.821	882.712	13.402.866
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	82.129.756	82.129.756
Total	-	389.263	-	139.070	11.991.821	83.012.468	95.532.622
Emerging Markets Impact Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	382	5.547	300.444	9.563.505	-	9.869.878
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	484.773	484.773
Total	-	382	5.547	300.444	9.563.505	484.773	10.354.651
Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	1.441	9.578.573	15.866.426	120.743.115	-	146.189.555
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	17.681.120	17.681.120
Total	-	1.441	9.578.573	15.866.426	120.743.115	17.681.120	163.870.675
Emerging Markets Sustainable Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	22.006	149.347	-	171.353
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	872.763	872.763
Total	-	-	-	22.006	149.347	872.763	1.044.116

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
ESG Flex Choice Cautious Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	4.632	18.441	551.044	-	574.117
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	9.419	9.419
Total	-	-	4.632	18.441	551.044	9.419	583.536
ESG Flex Choice Growth Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	4.187	16.671	498.141	-	518.999
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	8.514	8.514
Total	-	-	4.187	16.671	498.141	8.514	527.513
ESG Global Conservative Income Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	378	716.232	1.519.683	15.223.659	-	17.459.952
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	958.591	958.591
Total	-	378	716.232	1.519.683	15.223.659	958.591	18.418.543
ESG Global Multi-Asset Income Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	27.703	188.018	-	215.721
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	927.740	927.740
Total	-	-	-	27.703	188.018	927.740	1.143.461
ESG Multi-Asset Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	20.142	7.084.879	3.527.777	86.648.729	43.917	97.325.444
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	330.577.848	330.577.848
Total	-	20.142	7.084.879	3.527.777	86.648.729	330.621.765	427.903.292
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (en USD)⁽⁴⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	80	210	72.509	1.519.705	-	1.592.504
Total	-	80	210	72.509	1.519.705	-	1.592.504
Euro Bond Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	1.140	18.352.108	12.362.515	186.807.423	-	217.523.186
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	116.926.791	116.926.791
Total	-	1.140	18.352.108	12.362.515	186.807.423	116.926.791	334.449.977
Euro Corporate Bond Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	952	5.904.080	9.937.257	90.703.208	-	106.545.497
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	31.803.109	31.803.109
Total	-	952	5.904.080	9.937.257	90.703.208	31.803.109	138.348.606

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
Euro Short Duration Bond Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	458	28.593.716	13.830.878	459.148.081	-	501.573.133
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	541.592.995	541.592.995
Total	-	458	28.593.716	13.830.878	459.148.081	541.592.995	1.043.166.128
Euro-Markets Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	769.218	51.358	611.828	28.332.256	1.744.316	31.508.976
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	53.651.010	53.651.010
Total	-	769.218	51.358	611.828	28.332.256	55.395.326	85.159.986
European Equity Income Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	16.861	-	433.038	3.368.605	38.234	3.856.738
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	52.589.236	52.589.236
Total	-	16.861	-	433.038	3.368.605	52.627.470	56.445.974
European Focus Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	201.990	532.486	-	734.476
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	15.911.552	15.911.552
Total	-	-	-	201.990	532.486	15.911.552	16.646.028
European Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	52.372	4.176.917	10.074.332	-	14.303.621
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	66.299.351	66.299.351
Total	-	-	52.372	4.176.917	10.074.332	66.299.351	80.602.972
European High Yield Bond Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	248	1.899.460	3.558.236	33.247.051	-	38.704.995
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.682.907	1.682.907
Total	-	248	1.899.460	3.558.236	33.247.051	1.682.907	40.387.902
European Special Situations Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	8.620	3.795.772	4.693.751	-	8.498.143
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	78.443.297	78.443.297
Total	-	-	8.620	3.795.772	4.693.751	78.443.297	86.941.440
European Sustainable Equity Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	6.054	5.192	-	11.246
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	346.858	346.858
Total	-	-	-	6.054	5.192	346.858	358.104

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
European Value Fund (en EUR)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	22.149	291.472	-	313.621
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	8.788.165	8.788.165
Total	-	-	-	22.149	291.472	8.788.165	9.101.786
FinTech Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	1.646	24.540	2.223.053	-	2.249.239
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	21.294.066	21.294.066
Total	-	-	1.646	24.540	2.223.053	21.294.066	23.543.305
Fixed Income Global Opportunities Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	1.097	5.618.336	14.706.914	371.464.547	-	391.790.894
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.002.508.263	1.002.508.263
Total	-	1.097	5.618.336	14.706.914	371.464.547	1.002.508.263	1.394.299.157
<i>Garantie fournie – IFD de gré à gré</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	893.649	-	893.649
Total	-	-	-	-	893.649	-	893.649
Future Consumer Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.003.813	1.003.813
Total	-	-	-	-	-	1.003.813	1.003.813
Future Of Transport Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	161.655	1.804.420	29.689.526	3	31.655.604
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	60.211.329	60.211.329
Total	-	-	161.655	1.804.420	29.689.526	60.211.332	91.866.933
Global Allocation Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	3.201	701.782	29.293.160	30.486.784	913.293.179	51.715	973.829.821
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.553.669.650	1.553.669.650
Total	3.201	701.782	29.293.160	30.486.784	913.293.179	1.553.721.365	2.527.499.471
<i>Garantie fournie – IFD de gré à gré</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	5.031.725	28.980.623	-	34.012.348
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	489.362.788	489.362.788
Total	-	-	-	5.031.725	28.980.623	489.362.788	523.375.136
Global Corporate Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	105	824.928	1.604.491	25.006.590	-	27.436.114
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	4.098.626	4.098.626
Total	-	105	824.928	1.604.491	25.006.590	4.098.626	31.534.740

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
Global Dynamic Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	766	328.545	6.176.122	-	6.505.433
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	35.264.570	35.264.570
Total	-	-	766	328.545	6.176.122	35.264.570	41.770.003
<i>Garantie fournie – IFD de gré à gré</i>							
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	21.483.020	21.483.020
Total	-	-	-	-	-	21.483.020	21.483.020
Global Equity Income Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	949.253	6.442.367	2	7.391.622
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	20.936.345	20.936.345
Total	-	-	-	949.253	6.442.367	20.936.347	28.327.967
Global Government Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	162	3.698.340	3.119.730	55.948.781	-	62.767.013
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	51.673.066	51.673.066
Total	-	162	3.698.340	3.119.730	55.948.781	51.673.066	114.440.079
Global High Yield Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	1.174	3.454.296	8.771.070	99.944.852	-	112.171.392
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	14.214.865	14.214.865
Total	-	1.174	3.454.296	8.771.070	99.944.852	14.214.865	126.386.257
Global Inflation Linked Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	826.019	126.095	3.733.047	-	4.685.161
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	11.536.934	11.536.934
Total	-	-	826.019	126.095	3.733.047	11.536.934	16.222.095
Global Long-Horizon Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	239.004	951.616	28.552.562	-	29.743.182
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	2.544.106	2.544.106
Total	-	-	239.004	951.616	28.552.562	2.544.106	32.287.288
Global Multi-Asset Income Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	779.635	2.718.988	8.782.298	121.017.073	1.764.830	135.062.824
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	79.119.728	79.119.728
Total	-	779.635	2.718.988	8.782.298	121.017.073	80.884.558	214.182.552

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
Impact Bond Fund (en EUR)⁽²⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	40	89.083	19.250	1.102.962	-	1.211.335
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	208	208
Total	-	40	89.083	19.250	1.102.962	208	1.211.543
Japan Flexible Equity Fund (en JPY)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	257.718	36.691.627	5.525.449.888	79	5.562.399.312
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	7.627.747.735	7.627.747.735
Total	-	-	257.718	36.691.627	5.525.449.888	7.627.747.814	13.190.147.047
Japan Small & MidCap Opportunities Fund (en JPY)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	23.830.051	-	11.048.815	3.205.954.453	54.038.188	3.294.871.507
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	2.760.102.157	2.760.102.157
Total	-	23.830.051	-	11.048.815	3.205.954.453	2.814.140.345	6.054.973.664
Latin American Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	1.209.247	-	1.209.247
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	59.717.006	59.717.006
Total	-	-	-	-	1.209.247	59.717.006	60.926.253
Natural Resources Fund (en USD)⁽⁷⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	32.945	305.698	4.882.987	-	5.221.630
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	29.890.058	29.890.058
Total	-	-	32.945	305.698	4.882.987	29.890.058	35.111.688
Next Generation Health Care Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	78.763	-	78.763
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.984.026	1.984.026
Total	-	-	-	-	78.763	1.984.026	2.062.789
Next Generation Technology Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	1.208.869	37.237	949.790	72.091.253	2.741.291	77.028.440
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	238.009.992	238.009.992
Total	-	1.208.869	37.237	949.790	72.091.253	240.751.283	315.038.432
Nutrition Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	28.540	49.511	671.543	8.345.101	64.719	9.159.414
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	28.925.891	28.925.891
Total	-	28.540	49.511	671.543	8.345.101	28.990.610	38.085.305

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
Sustainable Asian Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	867.826	1.225.581	12.262.390	-	14.355.797
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	664.855	664.855
Total	-	-	867.826	1.225.581	12.262.390	664.855	15.020.652
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	63	383.610	709.483	6.597.442	-	7.690.598
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	198.699	198.699
Total	-	63	383.610	709.483	6.597.442	198.699	7.889.297
Sustainable Emerging Markets Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	222	1.063.550	2.012.418	17.448.564	-	20.524.754
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	2.821.755	2.821.755
Total	-	222	1.063.550	2.012.418	17.448.564	2.821.755	23.346.509
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	212	82.707	451.470	8.345.334	-	8.879.723
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	168.752	168.752
Total	-	212	82.707	451.470	8.345.334	168.752	9.048.475
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	1.057	2.033.623	4.266.492	40.698.878	-	47.000.050
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	2.275.996	2.275.996
Total	-	1.057	2.033.623	4.266.492	40.698.878	2.275.996	49.276.046
Sustainable Energy Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	3.102	-	5.658.236	49.363.608	7.041	55.031.987
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	314.821.340	314.821.340
Total	-	3.102	-	5.658.236	49.363.608	314.828.381	369.853.327
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (en EUR)⁽²⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	226	3.081	574.066	12.144.965	-	12.722.338
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	2.873.671	2.873.671
Total	-	226	3.081	574.066	12.144.965	2.873.671	15.596.009
<i>Garantie reçue – IFD de gré à gré</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	-	1.184.764	1.184.764
Total	-	-	-	-	-	1.184.764	1.184.764

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
Sustainable Global Bond Income Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	112	93.752	359.032	4.935.055	-	5.387.951
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	180.702	180.702
Total	-	112	93.752	359.032	4.935.055	180.702	5.568.653
Sustainable Global Infrastructure Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	1.264.025	1.264.025
Total	-	-	-	-	-	1.264.025	1.264.025
Sustainable World Bond Fund (en USD)⁽⁴⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	458	3.172.304	5.108.520	53.477.680	-	61.758.962
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	20.232.198	20.232.198
Total	-	458	3.172.304	5.108.520	53.477.680	20.232.198	81.991.160
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (en CHF)⁽⁵⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	6.997	-	1.646.255	10.828.284	15.868	12.497.404
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	64.830.557	64.830.557
Total	-	6.997	-	1.646.255	10.828.284	64.846.425	77.327.961
Systematic Global Equity High Income Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	228.758	22.699	3.387.611	40.188.143	518.750	44.345.961
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	328.280.051	328.280.051
Total	-	228.758	22.699	3.387.611	40.188.143	328.798.801	372.626.012
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund (en USD)⁽²⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	4.923	33.415	-	38.338
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	70.816	70.816
Total	-	-	-	4.923	33.415	70.816	109.154
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund (en USD)⁽⁴⁾							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	39.822	15.380	347.386	14.462.956	90.303	14.955.847
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	43.141.660	43.141.660
Total	-	39.822	15.380	347.386	14.462.956	43.231.963	58.097.507
United Kingdom Fund (en GBP)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	13.104	131.538	-	144.642
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	7.361.536	7.361.536
Total	-	-	-	13.104	131.538	7.361.536	7.506.178

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
US Basic Value Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	15.783	62.841	6.151.032	-	6.229.656
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	84.737.065	84.737.065
Total	-	-	15.783	62.841	6.151.032	84.737.065	90.966.721
US Dollar Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	305.213	309.979	3.250.924	-	3.866.116
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	4.957.535	4.957.535
Total	-	-	305.213	309.979	3.250.924	4.957.535	8.823.651
<i>Garantie fournie – IFD de gré à gré</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	21.209	-	21.209
<i>Garantie reçue – IFD de gré à gré</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	259.985	355.116	-	615.101
Total	-	-	-	259.985	376.325	-	636.310
US Dollar High Yield Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	1.751	3.201.238	7.015.390	80.445.331	-	90.663.710
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	22.381.161	22.381.161
Total	-	1.751	3.201.238	7.015.390	80.445.331	22.381.161	113.044.871
US Dollar Short Duration Bond Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	31	332.189	443.464	9.857.428	-	10.633.112
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	130.776.421	130.776.421
Total	-	31	332.189	443.464	9.857.428	130.776.421	141.409.533
US Flexible Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	398.427	3.527.964	1	3.926.392
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	144.024.903	144.024.903
Total	-	-	-	398.427	3.527.964	144.024.904	147.951.295
US Growth Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	238.052	1.620.833	1	1.858.886
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	38.542.671	38.542.671
Total	-	-	-	238.052	1.620.833	38.542.672	40.401.557

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
US Mid-Cap Value Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	17.998	117.738	2.497.209	-	2.632.945
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	29.512.948	29.512.948
Total	-	-	17.998	117.738	2.497.209	29.512.948	32.145.893
US Sustainable Equity Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	-	-	126.516	-	126.516
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	111.650	111.650
Total	-	-	-	-	126.516	111.650	238.166
World Energy Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	760.877	-	-	24.126.250	1.725.401	26.612.528
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	141.319.377	141.319.377
Total	-	760.877	-	-	24.126.250	143.044.778	167.931.905
World Financials Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	-	6.675	175.658	3.766.239	-	3.948.572
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	82.865.889	82.865.889
Total	-	-	6.675	175.658	3.766.239	82.865.889	86.814.461
World Gold Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	5.298.630	808.257	3.218.158	240.095.655	12.015.427	261.436.127
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	140.883.543	140.883.543
Total	-	5.298.630	808.257	3.218.158	240.095.655	152.898.970	402.319.670
World Healthscience Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	888.597	89.363	3.851.125	67.406.036	2.015.032	74.250.153
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	437.935.290	437.935.290
Total	-	888.597	89.363	3.851.125	67.406.036	439.950.322	512.185.443
World Mining Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	167.723	1.002.860	6.181.461	147.041.323	380.337	154.773.704
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	392.324.422	392.324.422
Total	-	167.723	1.002.860	6.181.461	147.041.323	392.704.759	547.098.126
World Real Estate Securities Fund (en USD)							
<i>Garantie reçue – Prêts de titres</i>							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	-	43.110	10.808	43.034	5.082.289	97.758	5.276.999
Actions							
Indice d'actions reconnu	-	-	-	-	-	13.801.587	13.801.587
Total	-	43.110	10.808	43.034	5.082.289	13.899.345	19.078.586

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Type et qualité de la garantie	Échéance					Opérations ouvertes	Total
	1 à 7 jours	8 à 30 jours	31 à 90 jours	91 à 365 jours	Plus de 365 jours		
World Technology Fund (en USD)							
Garantie reçue – Prêts de titres							
Titres à revenu fixe							
Catégorie d'investissement	–	622.415	–	3.646.421	65.313.338	1.411.427	70.993.601
Actions							
Indice d'actions reconnu	–	–	–	–	–	664.749.572	664.749.572
Total	–	622.415	–	3.646.421	65.313.338	666.160.999	735.743.173

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Les titres investment grade sont ceux émis par une entité possédant une notation minimale de crédit investment grade attribuée par au moins une agence de notation mondialement reconnue : Standard & Poor's, Moody's ou Fitch.

Un indice d'actions reconnu contient au moins 20 actions parmi lesquelles aucune action individuelle ne représente plus de 20 % du total de l'indice et aucune combinaison de cinq actions ne représente plus de 60 % du total de l'indice.

L'analyse de l'échéance pour les titres de créance reçus ou fournis en garantie est fondée sur la date d'échéance contractuelle concernée, tandis que les actions et les ETF reçus ou fournis en garantie sont présentés en tant qu'opérations ouvertes puisqu'elles ne sont soumises à aucune date d'échéance contractuelle.

Toutes les liquidités reçues ou fournies en garantie ont une échéance ouverte puisqu'elles ne sont pas soumises à une date d'échéance contractuelle.

Conservation de la garantie reçue

Au 31 août 2023, toutes les garanties autres qu'en numéraire reçues par les Compartiments en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD négociés de gré à gré (y compris des TRS et des CFD) sont détenues par le Dépositaire du Fonds (ou par ses délégués), à l'exception des montants publiés dans le tableau suivant, qui sont détenus par un système de règlement des titres.

Dépositaire	Garantie autre qu'en numéraire reçue
	Prêts de titres
Asian High Yield Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	143.607.422
Asian Multi-Asset Income Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	3.478.953
Asian Tiger Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	365.061.122
China Bond Fund (en CNH)	
Euroclear Bank SA/NV	683.031.303
Dynamic High Income Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	50.171.109
Emerging Markets Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	133.134.211
Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	92.668.525
Emerging Markets Impact Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	4.050.922
Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	131.144.617
ESG Global Conservative Income Fund (en EUR)	
Euroclear Bank SA/NV	15.707.306

Dépositaire	Garantie autre qu'en numéraire reçue
	Prêts de titres
ESG Multi-Asset Fund (en EUR)	
Euroclear Bank SA/NV	55.890.790
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (en USD)⁽⁴⁾	
Euroclear Bank SA/NV	848.206
Euro Bond Fund (en EUR)	
Euroclear Bank SA/NV	161.837.151
Euro Corporate Bond Fund (en EUR)	
Euroclear Bank SA/NV	81.968.988
Euro Short Duration Bond Fund (en EUR)	
Euroclear Bank SA/NV	248.297.901
European High Yield Bond Fund (en EUR)	
Euroclear Bank SA/NV	27.576.133
Fixed Income Global Opportunities Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	155.344.455
Global Allocation Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	433.653.294
Global Corporate Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	17.680.725
Global Government Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	39.904.431
Global High Yield Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	71.744.870
Global Inflation Linked Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	3.131.696
Global Multi-Asset Income Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	69.152.623
Impact Bond Fund (en EUR)⁽²⁾	
Euroclear Bank SA/NV	729.636
Sustainable Asian Bond Fund (en USD)	
Euroclear Bank SA/NV	10.291.474

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Dépositaire	Garantie autre qu'en numéraire reçue	
	Prêts de titres	
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (en USD)		
Euroclear Bank SA/NV		5.566.451
Sustainable Emerging Markets Bond Fund (en USD)		
Euroclear Bank SA/NV		17.289.984
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)		
Euroclear Bank SA/NV		5.929.836
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)		
Euroclear Bank SA/NV		36.096.461
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (en EUR)		
Euroclear Bank SA/NV		7.268.255
Sustainable Global Bond Income Fund (en USD)		
Euroclear Bank SA/NV		3.026.249
Sustainable World Bond Fund (en USD)⁽⁴⁾		
Euroclear Bank SA/NV		46.904.763
US Dollar Bond Fund (en USD)		
Euroclear Bank SA/NV		3.446.017
US Dollar High Yield Bond Fund (en USD)		
Euroclear Bank SA/NV		64.760.495
US Dollar Short Duration Bond Fund (en USD)		
Euroclear Bank SA/NV		4.333.398

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Concentration de garanties reçues

Le tableau suivant présente les dix plus grands émetteurs, en valeur, de garanties autres qu'en numéraire reçues par les Compartiments au moyen d'un contrat de garantie avec transfert de propriété en relation avec des opérations de prêt de titres et des IFD négociés de gré à gré (y compris des TRS et des CFD), au 31 août 2023.

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Asian Dragon Fund (en USD)		
Horizon Therapeutics	496.581	0,06
Kenvue	345.680	0,04
Intuitive Surgical	310.282	0,04
Microsoft	264.683	0,03
Hitachi	232.068	0,03
Activision Blizzard	222.859	0,03
Mitsubishi Heavy	219.991	0,03
Hilton Worldwide	210.108	0,03
Krispy Kreme	206.471	0,03
CenterPoint Energy	196.615	0,03
Autres émetteurs	4.926.963	0,63
Total	7.632.301	0,98
Asian Growth Leaders Fund (en USD)		
Industria de Diseno Textil	763.392	0,13
NatWest	763.384	0,13
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	725.749	0,12
Iberdrola	689.556	0,12
STMicroelectronics	626.554	0,11
Eni SpA	594.451	0,10
Banco Santander	478.979	0,08
Enel SpA	450.580	0,08
UniCredit SpA	390.142	0,07
Japan Post Bank	344.229	0,06
Autres émetteurs	2.355.345	0,40
Total	8.182.361	1,40

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Asian High Yield Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	41.067.916	2,71
Republic of Austria Government	30.162.315	1,99
United States Treasury	28.520.572	1,88
United Kingdom Gilt	21.853.628	1,44
Kingdom of Belgium Government	20.282.875	1,34
Finland Government	13.090.133	0,86
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	11.520.518	0,76
Netherlands Government	6.291.254	0,42
Republic of Germany	11.156.809	0,74
Canadian Government	3.621.762	0,24
Autres émetteurs	6.996.816	0,46
Total	194.564.598	12,84
Asian Multi-Asset Income Fund (en USD)		
French Republic Government	1.023.649	1,47
United States Treasury	804.036	1,16
Republic of Austria Government	594.211	0,85
United Kingdom Gilt	523.034	0,75
Kingdom of Belgium Government	426.783	0,61
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	301.792	0,43
Netherlands Government	246.982	0,35
Finland Government	233.192	0,34
Republic of Germany	322.524	0,46
Australia Government	73.410	0,11
Autres émetteurs	1.362.242	1,96
Total	5.911.855	8,49
Asian Sustainable Equity Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	25.567	0,30
United States Treasury	25.567	0,30
Tokyo Electron	13.457	0,16
Cisco Systems	13.457	0,16
Mondelez	12.373	0,15
Comcast	12.015	0,14
Archer-Daniels-Midland	11.053	0,13
Philip Morris	9.846	0,12
Coca-Cola	9.082	0,11
Ajinomoto	5.066	0,06
Autres émetteurs	8.104	0,10
Total	145.587	1,73
Asian Tiger Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	82.146.079	2,94
United States Treasury	68.245.179	2,44
Republic of Austria Government	65.016.878	2,33
Finland Government	43.211.488	1,55
Republic of Germany	38.925.279	1,39
United Kingdom Gilt	37.455.362	1,34
Kingdom of Belgium Government	35.898.781	1,28
Netherlands Government	27.023.777	0,97
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	22.485.718	0,80
Canadian Government	17.204.373	0,62
Autres émetteurs	53.050.546	1,9
Total	490.663.460	17,56

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
China Bond Fund (en CNH)		
French Republic Government	202.223.370	0,77
Republic of Austria Government	145.286.278	0,55
United States Treasury	128.784.580	0,49
Kingdom of Belgium Government	94.482.214	0,36
Finland Government	89.974.228	0,34
Republic of Germany	57.469.650	0,22
United Kingdom Gilt	40.640.998	0,15
Netherlands Government	37.242.072	0,14
Canadian Government	32.238.949	0,12
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	25.114.093	0,10
Autres émetteurs	85.245.925	0,32
Total	938.702.357	3,56
China Flexible Equity Fund (en USD)		
Novo Nordisk	43.528	0,20
Stellantis	43.117	0,20
Berkshire Hathaway	43.103	0,20
Intel	43.103	0,20
Alphabet	43.102	0,20
Medtronic	43.102	0,20
Apple	43.102	0,20
Micron Technology	43.102	0,20
Tesla	43.055	0,20
United States Treasury	25.479	0,12
Autres émetteurs	59.459	0,27
Total	473.252	2,19
China Fund (en USD)		
KDDI	1.389.016	0,14
SoftBank	1.386.791	0,14
Fast Retailing	1.383.093	0,14
United Kingdom Gilt	1.363.167	0,13
Microsoft	1.172.824	0,11
Alphabet	1.160.596	0,11
Fujitsu	1.003.760	0,10
Dentsu	951.779	0,09
Sekisui House	914.420	0,09
Nitto Denko	894.927	0,09
Autres émetteurs	32.967.612	3,23
Total	44.587.985	4,37
China Innovation Fund (en USD)		
Microsoft	42.988	0,21
Hitachi	37.691	0,18
Mitsubishi Heavy	35.730	0,17
Alphabet	31.889	0,15
PPL	18.088	0,09
Owens Corning	17.092	0,08
New Relic	16.363	0,08
TDK	16.325	0,08
Advanced Micro Devices	15.974	0,08
Shinko Electric	14.085	0,07
Autres émetteurs	183.663	0,88
Total	429.888	2,07

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Circular Economy Fund (en USD)		
Microsoft	10.486.567	0,63
Cisco Systems	7.991.874	0,48
Apple	7.824.952	0,47
Berkshire Hathaway	7.437.851	0,45
Flowers Foods	6.837.559	0,41
Knight-Swift Transportation	6.818.269	0,41
Meta Platforms	6.226.799	0,37
Amazon.com	5.806.573	0,35
Motorola Solutions	4.377.735	0,26
Ecolab	4.377.710	0,26
Autres émetteurs	88.890.468	5,34
Total	157.076.357	9,43
Climate Action Equity Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	13.783	0,30
United States Treasury	13.783	0,30
Netherlands Government	13.783	0,30
Republic of Germany	12.783	0,28
Spain Government	6.148	0,13
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	3.867	0,08
Asian Development Bank	3.185	0,07
Canadian Government	2.589	0,06
Inter-American Development Bank	2.089	0,05
French Republic Government	1.330	0,03
Autres émetteurs	2.922	0,06
Total	76.262	1,66
Climate Action Multi-Asset Fund (en EUR)		
Industria de Diseno Textil	120.814	0,27
NatWest	120.813	0,27
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	114.857	0,25
Iberdrola	109.129	0,24
United Kingdom Gilt	105.947	0,23
STMicroelectronics	99.158	0,22
Eni SpA	94.078	0,21
United States Treasury	83.604	0,18
Banco Santander	75.803	0,17
Enel SpA	71.309	0,16
Autres émetteurs	1.112.404	2,44
Total	2.107.916	4,64
Continental European Flexible Fund (en EUR)		
United Kingdom Gilt	14.048.895	0,26
United States Treasury	6.394.553	0,12
Toshiba	5.330.813	0,10
NVIDIA	5.330.733	0,10
Netherlands Government	4.745.406	0,09
Republic of Germany	4.400.865	0,08
Microsoft	4.390.541	0,08
Itochu Techno-Solutions	3.481.735	0,07
Disco	2.748.811	0,05
Amazon.com	2.541.599	0,05
Autres émetteurs	110.176.743	2,08
Total	163.590.694	3,08

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Developed Markets Sustainable Equity Fund (en USD)		
Microsoft	81.633	0,47
Hitachi	71.574	0,41
Mitsubishi Heavy	67.849	0,39
Alphabet	60.557	0,35
PPL	34.348	0,20
Owens Corning	32.458	0,19
New Relic	31.072	0,18
TDK	31.000	0,18
Advanced Micro Devices	30.334	0,18
Shinko Electric	26.746	0,15
Autres émetteurs	348.772	2,02
Total	816.343	4,72
Dynamic High Income Fund (en USD)		
United States Treasury	16.541.293	0,58
French Republic Government	11.194.466	0,40
United Kingdom Gilt	9.833.286	0,35
Republic of Germany	9.754.179	0,34
Netherlands Government	6.818.962	0,24
Republic of Austria Government	6.344.165	0,22
Kingdom of Belgium Government	6.096.076	0,22
Apple	5.274.256	0,19
Berkshire Hathaway	4.695.146	0,17
Microsoft	4.607.104	0,16
Autres émetteurs	95.822.450	3,47
Total	176.981.383	6,26
Emerging Europe Fund (en EUR)⁽⁹⁾		
United Kingdom Gilt	413.227	0,16
Industria de Diseno Textil	266.538	0,10
NatWest	266.536	0,10
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	253.395	0,10
Iberdrola	240.758	0,09
STMicroelectronics	218.761	0,08
Alphabet	210.356	0,08
Eni SpA	207.552	0,08
Toshiba	199.328	0,07
NVIDIA	199.325	0,07
Autres émetteurs	5.599.111	2,1
Total	8.074.887	3,03
Emerging Markets Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	25.403.292	2,58
United States Treasury	20.906.300	2,13
Republic of Austria Government	20.563.017	2,09
Finland Government	18.841.833	1,92
Republic of Germany	13.690.405	1,39
Kingdom of Belgium Government	10.370.733	1,06
Canadian Government	9.913.771	1,01
Netherlands Government	8.649.551	0,88
United Kingdom Gilt	7.196.997	0,73
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	5.719.702	0,58
Autres émetteurs	13.827.935	1,42
Total	155.083.536	15,79

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	20.801.630	2,67
United States Treasury	18.063.315	2,32
Republic of Austria Government	14.268.991	1,83
Republic of Germany	11.889.221	1,53
Netherlands Government	11.638.260	1,49
Finland Government	10.894.804	1,4
Kingdom of Belgium Government	10.670.142	1,37
United Kingdom Gilt	9.033.839	1,16
Canadian Government	4.600.929	0,59
Spain Government	4.428.198	0,57
Autres émetteurs	12.113.180	1,55
Total	128.402.509	16,48
Emerging Markets Equity Income Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	515.475	0,25
Toshiba	211.274	0,10
NVIDIA	211.271	0,10
United States Treasury	205.679	0,10
Industria de Diseno Textil	185.124	0,09
NatWest	185.122	0,09
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	175.995	0,09
Iberdrola	167.218	0,08
STMicroelectronics	151.940	0,07
Eni SpA	144.155	0,07
Autres émetteurs	3.441.476	1,68
Total	5.594.729	2,72
Emerging Markets Fund (en USD)		
Microsoft	6.892.206	0,28
Apple	6.219.704	0,25
Cisco Systems	6.040.924	0,24
Berkshire Hathaway	5.907.625	0,24
Flowers Foods	5.364.914	0,21
Knight-Swift Transportation	5.349.778	0,21
Meta Platforms	3.559.679	0,14
Motorola Solutions	3.434.877	0,14
Ecolab	3.434.857	0,14
Stryker	3.380.381	0,14
Autres émetteurs	45.947.677	1,84
Total	95.532.622	3,83
Emerging Markets Impact Bond Fund (en USD)		
United States Treasury	1.916.117	2,08
United Kingdom Gilt	1.899.948	2,06
Republic of Germany	1.784.550	1,93
Netherlands Government	1.784.037	1,93
Spain Government	1.014.863	1,10
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	804.817	0,87
Kingdom of Belgium Government	185.246	0,20
Sweden Government	158.073	0,17
International Bank for Reconstruction & Development	123.969	0,13
Republic of Austria Government Bond	93.326	0,10
Autres émetteurs	589.705	0,64
Total	10.354.651	11,21

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	40.969.936	2,52
United States Treasury	26.959.567	1,66
Republic of Austria Government	18.812.772	1,16
Finland Government	15.682.968	0,96
Republic of Germany	12.053.612	0,74
United Kingdom Gilt	7.837.305	0,48
Kingdom of Belgium Government	7.570.235	0,47
Netherlands Government	6.172.633	0,38
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.630.384	0,28
Australia Government Bond	2.493.732	0,15
Autres émetteurs	20.687.531	1,27
Total	163.870.675	10,07
Emerging Markets Sustainable Equity Fund (en USD)		
United States Treasury	85.677	0,11
United Kingdom Gilt	85.676	0,11
Microsoft	55.624	0,07
Hitachi	48.770	0,06
Mitsubishi Heavy	46.232	0,06
Cisco Systems	45.093	0,06
Tokyo Electron	45.093	0,06
Mondelez	41.464	0,05
Alphabet	41.263	0,05
Comcast	40.261	0,05
Autres émetteurs	508.963	0,66
Total	1.044.116	1,34
ESG Flex Choice Cautious Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	105.467	1,07
United States Treasury	105.467	1,07
Netherlands Government	105.467	1,07
Republic of Germany	97.809	0,99
Spain Government	47.039	0,48
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	29.587	0,30
Asian Development Bank	24.372	0,25
Canadian Government	19.813	0,20
Inter-American Development Bank	15.987	0,16
French Republic Government	10.175	0,10
Autres émetteurs	22.353	0,23
Total	583.536	5,92
ESG Flex Choice Growth Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	95.341	0,77
United States Treasury	95.341	0,77
Netherlands Government	95.341	0,77
Republic of Germany	88.419	0,71
Spain Government	42.523	0,34
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	26.746	0,22
Asian Development Bank	22.033	0,18
Canadian Government	17.911	0,14
Inter-American Development Bank	14.452	0,12
French Republic Government	9.198	0,07
Autres émetteurs	20.208	0,16
Total	527.513	4,25

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
ESG Global Conservative Income Fund (en EUR)		
French Republic Government	4.039.504	1,10
United States Treasury	3.242.879	0,88
Netherlands Government	1.550.387	0,42
Republic of Austria Government	1.536.965	0,42
Republic of Germany	1.515.242	0,41
Kingdom of Belgium Government	1.361.539	0,37
United Kingdom Gilt	1.173.637	0,32
Finland Government	1.043.345	0,28
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	992.137	0,27
Australia Government	494.006	0,13
Autres émetteurs	1.468.902	0,4
Total	18.418.543	5,00
ESG Global Multi-Asset Income Fund (en USD)		
United States Treasury	107.861	0,06
United Kingdom Gilt	107.860	0,06
Cisco Systems	56.769	0,03
Tokyo Electron	56.769	0,03
Mondelez	52.200	0,03
Comcast	50.686	0,03
Archer-Daniels-Midland	46.627	0,03
Philip Morris	41.538	0,02
Coca-Cola	38.313	0,02
Microsoft	33.818	0,02
Autres émetteurs	551.020	0,33
Total	1.143.461	0,66
ESG Multi-Asset Fund (en EUR)		
United States Treasury	26.263.283	0,43
French Republic Government	18.920.215	0,31
Microsoft	17.519.443	0,29
Republic of Germany	12.014.085	0,2
Kingdom of Belgium Government	11.586.197	0,19
New Relic	9.790.257	0,16
NVIDIA	9.441.041	0,16
United Kingdom Gilt	9.670.721	0,16
Netherlands Government	7.265.324	0,12
Alphabet	6.411.806	0,11
Autres émetteurs	299.020.920	4,93
Total	427.903.292	7,06
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (en USD)⁽⁴⁾		
United States Treasury	297.086	0,32
United Kingdom Gilt	293.675	0,32
Republic of Germany	236.786	0,26
Netherlands Government	199.551	0,22
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	162.488	0,18
Kingdom of Belgium Government	124.625	0,14
French Republic Government	97.324	0,11
Republic of Austria Government	89.944	0,10
Spain Government	38.411	0,04
Asian Development Bank	20.483	0,02
Autres émetteurs	32.131	0,03
Total	1.592.504	1,74

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment	Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Euro Bond Fund (en EUR)			European Equity Income Fund (en EUR)		
French Republic Government	52.692.664	2,70	Novo Nordisk	2.838.127	0,18
Republic of Germany	35.487.985	1,82	Stellantis	2.477.759	0,16
United States Treasury	31.769.212	1,63	Alphabet	2.348.288	0,15
Kingdom of Belgium Government	25.860.905	1,33	Apple	2.319.227	0,15
Republic of Austria Government	19.935.463	1,02	Micron Technology	2.303.874	0,15
United Kingdom Gilt	18.634.012	0,96	Intel	2.302.994	0,15
Netherlands Government	11.557.873	0,59	Berkshire Hathaway	2.302.992	0,15
Finland Government	9.059.578	0,47	Medtronic	2.302.990	0,15
Lixil	6.669.841	0,34	Tesla	2.300.472	0,15
Mitsubishi UFJ Financial	6.550.446	0,34	United States Treasury	2.083.172	0,13
Autres émetteurs	116.231.998	5,96	Autres émetteurs	32.866.079	2,10
Total	334.449.977	17,16	Total	56.445.974	3,62
Euro Corporate Bond Fund (en EUR)			European Focus Fund (en EUR)		
French Republic Government	25.491.389	0,91	Alphabet	932.618	0,27
United States Treasury	21.449.920	0,77	Novo Nordisk	678.556	0,20
Republic of Austria Government	12.994.817	0,46	Stellantis	625.967	0,18
Finland Government	9.306.977	0,33	Apple	619.912	0,18
Republic of Germany	8.681.159	0,31	Micron Technology	608.445	0,18
United Kingdom Gilt	8.803.031	0,31	Intel	607.786	0,18
Kingdom of Belgium Government	6.051.389	0,22	Berkshire Hathaway	607.786	0,18
Netherlands Government	5.369.892	0,19	Medtronic	607.785	0,18
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	3.605.113	0,13	Tesla	607.121	0,18
Apple	2.697.805	0,10	Microsoft	508.531	0,15
Autres émetteurs	33.897.114	1,21	Autres émetteurs	10.241.521	3,01
Total	138.348.606	4,94	Total	16.646.028	4,89
Euro Short Duration Bond Fund (en EUR)			European Fund (en EUR)		
French Republic Government	121.785.884	2,57	United Kingdom Gilt	8.715.757	0,65
Republic of Germany	91.635.455	1,93	NVIDIA	4.663.280	0,35
United Kingdom Gilt	77.359.293	1,63	Toshiba	4.651.979	0,35
United States Treasury	75.730.111	1,6	Itochu Techno-Solutions	3.038.365	0,23
Kingdom of Belgium Government	38.988.610	0,82	Disco	2.398.774	0,18
Toronto-Dominion Bank	34.448.285	0,73	Ibiden	1.795.057	0,13
Royal Bank of Canada	26.392.401	0,56	Medley	1.784.774	0,13
Marsh & McLennan	26.392.296	0,56	United States Treasury	1.399.196	0,10
Shell	25.884.344	0,55	Suzuken/Aichi Japan	1.322.562	0,10
Republic of Austria Government	24.961.450	0,53	Netherlands Government	1.192.560	0,09
Autres émetteurs	499.587.999	10,55	Autres émetteurs	49.640.668	3,71
Total	1.043.166.128	22,03	Total	80.602.972	6,02
Euro-Markets Fund (en EUR)			European High Yield Bond Fund (en EUR)		
United States Treasury	6.716.247	0,53	French Republic Government	9.656.292	3,01
United Kingdom Gilt	5.782.221	0,46	United States Treasury	6.933.061	2,16
French Republic Government	4.173.409	0,33	Republic of Austria Government	5.083.541	1,58
Australia Government	4.060.577	0,32	Kingdom of Belgium Government	3.214.348	1,00
Kingdom of Belgium Government	3.673.672	0,29	United Kingdom Gilt	3.066.872	0,96
Industria de Diseno Textil	2.518.503	0,20	Finland Government	3.015.112	0,94
NatWest	2.518.477	0,20	Republic of Germany	2.918.534	0,91
Ireland Government	2.451.510	0,19	Netherlands Government	1.844.653	0,58
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	2.394.313	0,19	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	981.283	0,31
Iberdrola	2.274.910	0,18	Spain Government	619.629	0,19
Autres émetteurs	48.596.147	3,80	Autres émetteurs	3.054.577	0,95
Total	85.159.986	6,69	Total	40.387.902	12,59

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment	Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
European Special Situations Fund (en EUR)			Fixed Income Global Opportunities Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	7.335.154	0,59	United States Treasury	97.718.146	1,35
Toshiba	4.380.448	0,35	French Republic Government	70.393.620	0,97
NVIDIA	4.380.382	0,35	Microsoft	69.722.133	0,97
Itochu Techno-Solutions	2.861.019	0,23	Swiss Confederation Government	48.100.940	0,67
Microsoft	2.809.256	0,23	Republic of Germany	35.093.115	0,49
Hitachi	2.347.548	0,19	Republic of Austria Government	33.937.400	0,47
Disco	2.258.760	0,18	United Kingdom Gilt	31.894.257	0,44
Mitsubishi Heavy	2.225.381	0,18	Amazon.com	29.130.022	0,40
Alphabet	1.986.201	0,16	Nestle	29.129.971	0,40
Ibiden	1.690.282	0,14	Prosus	25.033.370	0,35
Autres émetteurs	54.667.009	4,41	Autres émetteurs	924.146.183	12,79
Total	86.941.440	7,01	Total	1.394.299.157	19,30
European Sustainable Equity Fund (en EUR)			Future Consumer Fund (en USD)		
NatWest	27.951	0,50	Microsoft	100.380	0,78
Industria de Diseno Textil	27.951	0,50	Hitachi	88.011	0,68
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	26.573	0,48	Mitsubishi Heavy	83.431	0,64
Iberdrola	25.248	0,45	Alphabet	74.464	0,58
STMicroelectronics	22.941	0,41	PPL	42.236	0,33
Eni SpA	21.765	0,39	Owens Corning	39.911	0,31
Banco Santander	17.537	0,31	New Relic	38.208	0,30
Enel SpA	16.498	0,30	TDK	38.119	0,29
UniCredit SpA	14.285	0,26	Advanced Micro Devices	37.300	0,29
Japan Post Bank	12.604	0,23	Shinko Electric	32.888	0,25
Autres émetteurs	144.751	2,60	Autres émetteurs	428.865	3,31
Total	358.104	6,43	Total	1.003.813	7,76
European Value Fund (en EUR)			Future Of Transport Fund (en USD)		
Microsoft	501.469	0,07	United States Treasury	8.667.046	0,47
Novo Nordisk	389.821	0,05	United Kingdom Gilt	8.200.375	0,45
Meta Platforms	368.765	0,05	Netherlands Government	4.147.677	0,23
Alphabet	359.103	0,05	Republic of Germany	3.880.306	0,21
Amazon.com	339.279	0,05	Microsoft	3.403.070	0,19
Walmart	321.322	0,04	Cisco Systems	2.378.613	0,13
Las Vegas Sands	250.650	0,03	Tokyo Electron	2.378.605	0,13
Stellantis	249.637	0,03	Mondelez	2.187.167	0,12
Diageo	244.916	0,03	Comcast	2.123.744	0,12
Intel	238.787	0,03	Archer-Daniels-Midland	1.953.679	0,11
Autres émetteurs	5.838.037	0,81	Autres émetteurs	52.546.651	2,87
Total	9.101.786	1,24	Total	91.866.933	5,03
FinTech Fund (en USD)			Global Allocation Fund (en USD)		
Alphabet	1.895.973	0,74	United States Treasury	205.304.040	1,42
Microsoft	1.073.566	0,42	French Republic Government	139.739.646	0,97
Hitachi	941.279	0,37	United Kingdom Gilt	133.878.459	0,93
Mitsubishi Heavy	892.295	0,35	Republic of Germany	114.385.959	0,79
Novo Nordisk	835.250	0,33	Swiss Confederation Government	80.683.113	0,56
Stellantis	835.074	0,33	Netherlands Government	71.083.331	0,49
Berkshire Hathaway	827.086	0,32	Republic of Austria Government	68.012.215	0,47
Intel	827.086	0,32	Microsoft	61.062.953	0,42
Medtronic	827.085	0,32	Apple	55.684.351	0,39
Micron Technology	827.085	0,32	Amazon.com	55.540.583	0,38
Autres émetteurs	13.761.526	5,39	Autres émetteurs	1.542.124.821	10,66
Total	23.543.305	9,21	Total	2.527.499.471	17,48

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Global Corporate Bond Fund (en USD)		
United States Treasury	4.224.278	0,48
French Republic Government	3.851.330	0,44
Republic of Germany	3.105.036	0,35
Netherlands Government	2.803.151	0,32
Republic of Austria Government	2.727.800	0,31
United Kingdom Gilt	2.403.013	0,27
Finland Government	2.253.068	0,26
Kingdom of Belgium Government	2.052.773	0,23
Spain Government	1.596.364	0,18
Canadian Government	1.111.717	0,13
Autres émetteurs	5.406.210	0,62
Total	31.534.740	3,59
Global Dynamic Equity Fund (en USD)		
United States Treasury	2.462.028	0,60
Microsoft	2.053.851	0,50
United Kingdom Gilt	1.094.377	0,27
Meta Platforms	917.618	0,22
Amazon.com	838.195	0,20
Walmart	773.141	0,19
Horizon Therapeutics	765.309	0,19
Diageo	682.862	0,17
ING Groep	680.477	0,17
Republic of Germany	668.190	0,16
Autres émetteurs	30.833.955	7,54
Total	41.770.003	10,21
Global Equity Income Fund (en USD)		
United States Treasury	3.695.825	0,40
United Kingdom Gilt	3.695.785	0,40
Cisco Systems	1.945.170	0,21
Tokyo Electron	1.945.163	0,21
Mondelez	1.788.610	0,19
Comcast	1.736.744	0,19
Archer-Daniels-Midland	1.597.669	0,17
Philip Morris	1.423.296	0,15
Coca-Cola	1.312.770	0,14
Ajinomoto	732.276	0,08
Autres émetteurs	8.454.659	0,92
Total	28.327.967	3,06
Global Government Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	16.333.051	1,60
Republic of Germany	13.228.932	1,3
Kingdom of Belgium Government	8.009.834	0,79
United Kingdom Gilt	7.531.852	0,74
United States Treasury	7.141.720	0,7
Netherlands Government	3.425.049	0,34
Republic of Austria Government	3.206.897	0,31
Mitsubishi UFJ Financial	2.780.499	0,27
Lixil	2.604.471	0,26
Asics	2.456.661	0,24
Autres émetteurs	47.721.113	4,68
Total	114.440.079	11,23

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Global High Yield Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	21.982.508	1,32
United States Treasury	20.693.891	1,24
United Kingdom Gilt	12.827.539	0,77
Republic of Austria Government	11.429.535	0,69
Republic of Germany	10.111.428	0,61
Kingdom of Belgium Government	8.981.679	0,54
Netherlands Government	7.971.895	0,48
Finland Government	5.411.874	0,33
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.763.710	0,29
Spain Government	3.723.581	0,22
Autres émetteurs	18.488.617	1,12
Total	126.386.257	7,61
Global Inflation Linked Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	1.053.611	0,39
Kingdom of Belgium Government	941.533	0,35
Mitsubishi HC Capital	924.099	0,34
Industria de Diseno Textil	924.099	0,34
M&G	924.092	0,34
Mizuho Financial	924.054	0,34
Mitsubishi UFJ Financial	924.037	0,34
ORIX	924.021	0,34
Sumitomo Mitsui Financial	924.001	0,34
Zurich Insurance	847.588	0,31
Autres émetteurs	6.910.960	2,56
Total	16.222.095	5,99
Global Long-Horizon Equity Fund (en USD)		
United States Treasury	5.559.475	0,40
United Kingdom Gilt	5.442.371	0,39
Netherlands Government	5.442.371	0,39
Republic of Germany	5.047.227	0,36
Spain Government	2.427.350	0,18
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	1.526.753	0,11
Asian Development Bank	1.257.687	0,09
Canadian Government	1.022.418	0,07
Inter-American Development Bank	824.969	0,06
French Republic Government	525.048	0,04
Autres émetteurs	3.211.619	0,23
Total	32.287.288	2,32
Global Multi-Asset Income Fund (en USD)		
United States Treasury	25.028.245	0,52
French Republic Government	24.208.085	0,50
United Kingdom Gilt	18.916.828	0,39
Kingdom of Belgium Government	15.429.997	0,32
Republic of Germany	10.705.070	0,22
Republic of Austria Government	9.854.795	0,2
Netherlands Government	8.072.371	0,17
Australia Government	6.060.576	0,13
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	5.296.789	0,11
Microsoft	4.030.956	0,08
Autres émetteurs	86.578.840	1,8
Total	214.182.552	4,44

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Impact Bond Fund (en EUR)⁽²⁾		
Republic of Germany	227.702	0,30
Netherlands Government	222.154	0,29
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	179.329	0,24
French Republic Government	146.519	0,19
United Kingdom Gilt	113.617	0,15
Kingdom of Belgium Government	102.965	0,13
Austria Treasury Bill	89.083	0,12
United States Treasury	80.429	0,11
Norway Government	42.984	0,06
European Investment Bank	4.976	0,01
Autres émetteurs	1.785	0,00
Total	1.211.543	1,60
Japan Flexible Equity Fund (en JPY)		
United States Treasury	1.272.849.827	3,63
Netherlands Government	917.111.774	2,62
Republic of Germany	916.475.443	2,62
Canadian Government	912.341.551	2,60
French Republic Government	911.814.230	2,60
Microsoft	546.899.356	1,56
Kingdom of Belgium Government	479.849.585	1,37
Alphabet	264.118.520	0,75
Meta Platforms	254.756.116	0,73
Amazon.com	232.008.589	0,66
Autres émetteurs	6.481.922.056	18,50
Total	13.190.147.047	37,64
Japan Small & MidCap Opportunities Fund (en JPY)		
United States Treasury	665.159.666	3,10
French Republic Government	571.477.037	2,66
Netherlands Government	445.679.491	2,08
Canadian Government	445.677.442	2,08
Republic of Germany	445.576.661	2,08
Kingdom of Belgium Government	348.498.050	1,62
Microsoft	222.964.096	1,04
United Kingdom Gilt	148.229.524	0,69
Australia Government	125.794.935	0,59
Meta Platforms	104.672.264	0,49
Autres émetteurs	2.531.244.498	11,8
Total	6.054.973.664	28,23
Latin American Fund (en USD)		
Apple	3.003.888	0,32
Berkshire Hathaway	2.955.717	0,32
Alphabet	2.815.238	0,30
Novo Nordisk	2.065.870	0,22
Stellantis	2.046.359	0,22
Intel	2.045.678	0,22
Micron Technology	2.045.676	0,22
Medtronic	2.045.675	0,22
Tesla	2.043.439	0,22
Microsoft	1.995.597	0,21
Autres émetteurs	37.863.116	4,04
Total	60.926.253	6,51

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Natural Resources Fund (en USD)⁽⁷⁾		
Apple	2.079.767	0,55
Berkshire Hathaway	2.034.461	0,54
Alphabet	1.709.392	0,45
United States Treasury	1.563.892	0,42
Stellantis	1.413.779	0,38
Novo Nordisk	1.390.119	0,37
Micron Technology	1.377.101	0,37
Intel	1.376.533	0,37
Medtronic	1.376.530	0,37
Tesla	1.375.025	0,37
Autres émetteurs	19.415.089	5,15
Total	35.111.688	9,34
Next Generation Health Care Fund (en USD)		
Alphabet	158.490	0,86
Microsoft	106.618	0,58
Hitachi	93.481	0,51
Mitsubishi Heavy	88.616	0,48
Stellantis	74.773	0,41
Novo Nordisk	73.204	0,40
Berkshire Hathaway	72.488	0,39
Intel	72.488	0,39
Medtronic	72.488	0,39
Micron Technology	72.488	0,39
Autres émetteurs	1.177.655	6,41
Total	2.062.789	11,21
Next Generation Technology Fund (en USD)		
United States Treasury	15.147.581	0,59
French Republic Government	12.974.103	0,51
United Kingdom Gilt	12.500.275	0,49
Microsoft	12.145.443	0,47
Alphabet	11.638.889	0,45
Hitachi	8.957.986	0,35
Mitsubishi Heavy	8.491.810	0,33
Kingdom of Belgium Government	7.745.758	0,30
Republic of Germany	7.725.483	0,30
Industria de Diseno Textil	7.668.123	0,30
Autres émetteurs	210.042.981	8,19
Total	315.038.432	12,28
Nutrition Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	2.573.291	0,95
United States Treasury	2.147.820	0,79
Horizon Therapeutics	1.626.384	0,60
Kenvue	1.187.365	0,44
Netherlands Government	1.127.420	0,42
Intuitive Surgical	1.065.775	0,39
Republic of Germany	1.045.563	0,39
Activision Blizzard	765.492	0,28
Hilton Worldwide	721.693	0,27
Krispy Kreme	709.200	0,26
Autres émetteurs	25.115.302	9,3
Total	38.085.305	14,09

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Sustainable Asian Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	3.316.613	2,96
United States Treasury	2.481.170	2,21
Republic of Austria Government	2.093.429	1,87
Finland Government	1.385.722	1,23
United Kingdom Gilt	1.322.052	1,17
Republic of Germany	1.167.311	1,04
Spain Government	654.243	0,58
Netherlands Government	653.920	0,58
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	588.301	0,52
Kingdom of Belgium Government	486.434	0,43
Autres émetteurs	871.457	0,78
Total	15.020.652	13,37
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	2.015.019	4,71
United States Treasury	1.382.689	3,23
Republic of Austria Government	943.518	2,20
Kingdom of Belgium Government	688.548	1,61
Finland Government	562.513	1,31
Republic of Germany	557.449	1,31
United Kingdom Gilt	542.620	1,27
Netherlands Government	406.749	0,95
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	192.085	0,45
Australia Government	175.805	0,41
Autres émetteurs	422.302	0,99
Total	7.889.297	18,44
Sustainable Emerging Markets Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	5.466.227	2,53
United States Treasury	3.647.509	1,69
Republic of Austria Government	2.889.929	1,34
Finland Government	1.703.117	0,79
Kingdom of Belgium Government	1.590.824	0,74
United Kingdom Gilt	1.585.318	0,73
Republic of Germany	1.307.914	0,61
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	973.975	0,45
Netherlands Government	790.379	0,37
Australia Government Bond	334.617	0,15
Autres émetteurs	3.056.700	1,42
Total	23.346.509	10,82
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (en USD)		
United States Treasury	1.581.124	2,98
French Republic Government	1.191.821	2,24
United Kingdom Gilt	1.140.558	2,15
Netherlands Government	1.129.760	2,13
Republic of Germany	1.001.560	1,89
Kingdom of Belgium Government	666.084	1,25
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	617.474	1,16
Republic of Austria Government	487.709	0,92
Spain Government	476.483	0,90
Australia Government	220.986	0,42
Autres émetteurs	534.916	0,99
Total	9.048.475	17,03

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (en USD)		
French Republic Government	10.851.471	2,14
United States Treasury	8.782.650	1,73
Republic of Austria Government	5.353.452	1,06
United Kingdom Gilt	4.146.362	0,82
Republic of Germany	4.127.805	0,81
Kingdom of Belgium Government	3.772.339	0,74
Finland Government	3.243.924	0,64
Netherlands Government	2.959.557	0,58
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	2.136.439	0,42
Australia Government	808.511	0,16
Autres émetteurs	3.093.536	0,61
Total	49.276.046	9,71
Sustainable Energy Fund (en USD)		
United States Treasury	18.865.479	0,27
United Kingdom Gilt	17.980.317	0,26
Cisco Systems	12.839.028	0,19
Microsoft	11.793.647	0,17
Horizon Therapeutics	9.337.536	0,13
Tokyo Electron	7.505.091	0,11
Mondelez	6.901.057	0,10
Comcast	6.700.942	0,10
Kenvue	6.615.996	0,10
Meta Platforms	6.371.901	0,09
Autres émetteurs	264.942.333	3,82
Total	369.853.327	5,34
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (en EUR)		
United States Treasury	2.165.321	0,43
French Republic Government	2.085.605	0,41
Netherlands Government	1.593.035	0,31
United Kingdom Gilt	1.583.357	0,31
Republic of Germany	1.515.365	0,3
Kingdom of Belgium Government	1.215.833	0,24
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	610.721	0,12
Spain Government	563.660	0,11
Republic of Austria Government	506.832	0,10
Australia Government Bond	439.750	0,09
Autres émetteurs	3.316.530	0,66
Total	15.596.009	3,08
Sustainable Global Bond Income Fund (en USD)		
United States Treasury	997.169	0,90
French Republic Government	926.700	0,83
United Kingdom Gilt	659.853	0,59
Republic of Germany	547.358	0,49
Kingdom of Belgium Government	529.119	0,48
Netherlands Government	484.512	0,44
Republic of Austria Government	460.113	0,41
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	232.535	0,21
Finland Government	148.288	0,13
Spain Government Bond	144.824	0,13
Autres émetteurs	438.182	0,4
Total	5.568.653	5,01

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment	Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
Sustainable Global Infrastructure Fund (en USD)			Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund (en USD)⁽²⁾		
Industria de Diseno Textil	76.237	0,65	United Kingdom Gilt	19.169	0,09
NatWest	76.236	0,65	United States Treasury	19.169	0,09
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	72.477	0,62	Tokyo Electron	10.089	0,05
Iberdrola	68.863	0,59	Cisco Systems	10.089	0,05
STMicroelectronics	62.571	0,54	Mondelez	9.277	0,04
Eni SpA	59.365	0,51	Comcast	9.008	0,04
CoreCivic	50.166	0,43	Archer-Daniels-Midland	8.287	0,04
Ormat Technologies	50.166	0,43	Philip Morris	7.382	0,03
Ironwood Pharmaceuticals	50.166	0,43	Coca-Cola	6.809	0,03
Parsons	50.165	0,43	Ajinomoto	3.798	0,02
Autres émetteurs	647.613	5,56	Autres émetteurs	6.077	0,03
Total	1.264.025	10,84	Total	109.154	0,51
Sustainable World Bond Fund (en USD)⁽⁴⁾			Systematic Sustainable Global SmallCap Fund (en USD)⁽⁴⁾		
French Republic Government	12.870.482	1,39	United States Treasury	3.102.511	1,22
United States Treasury	9.691.968	1,05	Republic of Germany	2.304.267	0,90
Republic of Germany	8.943.140	0,97	French Republic Government	2.200.535	0,86
United Kingdom Gilt	6.925.300	0,75	Netherlands Government	2.156.127	0,84
Kingdom of Belgium Government	6.168.239	0,67	Alphabet	1.919.961	0,75
Republic of Austria Government	4.471.652	0,48	Canadian Government	1.871.698	0,73
Netherlands Government	3.462.251	0,37	Microsoft	1.849.317	0,72
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	3.202.350	0,35	United Kingdom Gilt	1.372.850	0,54
Finland Government	2.464.993	0,27	Horizon Therapeutics	1.343.798	0,53
Apple	1.497.924	0,16	Hitachi	1.238.601	0,49
Autres émetteurs	22.292.861	2,41	Autres émetteurs	38.737.842	15,17
Total	81.991.160	8,87	Total	58.097.507	22,75
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (en CHF)⁽⁵⁾			United Kingdom Fund (en GBP)		
United Kingdom Gilt	5.718.353	0,95	Horizon Therapeutics	416.725	0,20
Alphabet	3.394.102	0,56	Kenvue	285.929	0,13
United States Treasury	2.628.048	0,44	Microsoft	267.468	0,13
NVIDIA	2.234.773	0,37	Intuitive Surgical	256.649	0,12
Republic of Germany	2.151.883	0,36	Hitachi	234.510	0,11
Novo Nordisk	1.992.784	0,33	Mitsubishi Heavy	222.306	0,10
French Republic Government	1.899.731	0,32	Alphabet	219.642	0,10
Apple	1.883.446	0,31	Activision Blizzard	184.338	0,09
Stellantis	1.867.246	0,31	Hilton Worldwide	173.791	0,08
Micron Technology	1.803.298	0,30	Krispy Kreme	170.782	0,08
Autres émetteurs	51.754.297	8,62	Autres émetteurs	5.074.038	2,38
Total	77.327.961	12,87	Total	7.506.178	3,52
Systematic Global Equity High Income Fund (en USD)			US Basic Value Fund (en USD)		
United States Treasury	20.359.191	0,41	Horizon Therapeutics	5.209.509	0,59
United Kingdom Gilt	15.546.074	0,31	Kenvue	3.704.334	0,42
Microsoft	14.721.321	0,29	Intuitive Surgical	3.325.000	0,37
Horizon Therapeutics	10.439.145	0,21	Activision Blizzard	2.388.177	0,27
Cisco Systems	8.445.920	0,17	Microsoft	2.290.997	0,26
Kenvue	7.624.175	0,15	Hilton Worldwide	2.283.012	0,26
Meta Platforms	6.945.053	0,14	Krispy Kreme	2.212.558	0,25
Intuitive Surgical	6.843.440	0,14	Alphabet	2.209.066	0,25
Tokyo Electron	6.756.533	0,13	CenterPoint Energy	2.106.945	0,24
Amazon.com	6.739.033	0,13	ResMed	1.932.863	0,22
Autres émetteurs	268.206.127	5,35	Autres émetteurs	63.304.260	7,11
Total	372.626.012	7,43	Total	90.966.721	10,24

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment	Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
US Dollar Bond Fund (en USD)			US Growth Fund (en USD)		
French Republic Government	987.924	0,18	Horizon Therapeutics	2.577.223	0,66
United States Treasury	672.117	0,12	Kenvue	1.850.695	0,47
Kingdom of Belgium Government	502.378	0,09	Intuitive Surgical	1.661.179	0,42
Republic of Austria Government	495.887	0,09	Activision Blizzard	1.193.140	0,30
Finland Government	308.453	0,06	Hilton Worldwide	1.124.872	0,29
Netherlands Government	251.107	0,05	Krispy Kreme	1.105.400	0,28
Republic of Germany	243.775	0,04	CenterPoint Energy	1.052.635	0,27
Sumitomo Mitsui Financial	238.190	0,04	ResMed	965.664	0,25
Mitsubishi HC Capital	164.502	0,03	United Kingdom Gilt	928.648	0,24
Industria de Diseno Textil	164.501	0,03	United States Treasury	926.834	0,24
Autres émetteurs	4.794.817	0,87	Autres émetteurs	27.015.267	6,89
Total	8.823.651	1,60	Total	40.401.557	10,31
US Dollar High Yield Bond Fund (en USD)			US Mid-Cap Value Fund (en USD)		
United States Treasury	16.871.671	0,89	Horizon Therapeutics	1.487.885	0,61
French Republic Government	15.819.905	0,84	Alphabet	1.169.294	0,48
Republic of Germany	9.783.212	0,52	Kenvue	1.030.087	0,42
United Kingdom Gilt	9.147.162	0,49	Intuitive Surgical	924.603	0,38
Republic of Austria Government	8.441.321	0,45	Microsoft	854.719	0,35
Netherlands Government	7.922.521	0,42	Hitachi	749.399	0,31
Kingdom of Belgium Government	5.791.025	0,31	United States Treasury	726.228	0,30
Finland Government	5.306.588	0,28	Mitsubishi Heavy	710.400	0,29
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	5.000.918	0,27	Activision Blizzard	664.095	0,27
Spain Government	2.798.757	0,15	Hilton Worldwide	626.098	0,26
Autres émetteurs	26.161.791	1,38	Autres émetteurs	23.203.085	9,53
Total	113.044.871	6,00	Total	32.145.893	13,20
US Dollar Short Duration Bond Fund (en USD)			US Sustainable Equity Fund (en USD)		
NVIDIA	6.157.033	0,38	United Kingdom Gilt	44.149	0,92
Microsoft	6.156.999	0,38	Republic of Germany	44.149	0,92
Danone	6.119.319	0,38	French Republic Government	38.218	0,79
Prosus	6.119.314	0,38	Royal Bank of Canada	24.785	0,51
Societe Generale	6.119.284	0,38	Alphabet	24.343	0,51
Airbus SE	5.974.387	0,37	Amazon.com	24.343	0,51
New Relic	5.517.321	0,34	Canadian Pacific Kansas City	17.859	0,37
Snam SpA	5.130.028	0,32	NVIDIA	11.439	0,24
United States Treasury	5.058.602	0,31	Splunk	8.881	0,18
Uber Technologies	4.987.490	0,31	Total	238.166	4,95
Autres émetteurs	84.069.756	5,20	World Energy Fund (en USD)		
Total	141.409.533	8,75	Microsoft	10.690.069	0,36
US Flexible Equity Fund (en USD)			United States Treasury	8.432.308	0,28
Horizon Therapeutics	10.008.333	0,53	Iberdrola	5.288.951	0,18
Kenvue	7.284.417	0,39	ING Groep	4.257.375	0,14
Intuitive Surgical	6.538.473	0,35	French Republic Government	4.016.553	0,13
Activision Blizzard	4.696.250	0,25	Australia Government	4.016.545	0,13
Hilton Worldwide	4.427.545	0,24	Chevron	3.862.450	0,13
Krispy Kreme	4.350.902	0,23	Kingdom of Belgium Government	3.633.831	0,12
CenterPoint Energy	4.143.218	0,22	Hitachi	3.492.875	0,12
ResMed	3.800.894	0,20	Alphabet	3.371.612	0,11
Phillips 66	3.643.401	0,19	Autres émetteurs	116.869.336	3,91
W R Berkley	2.884.770	0,15	Total	167.931.905	5,61
Autres émetteurs	96.173.092	5,11			
Total	147.951.295	7,86			

Appendice IV – Informations supplémentaires (non révisé) suite

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
World Financials Fund (en USD)		
Horizon Therapeutics	5.395.407	0,30
Kenvue	3.881.032	0,22
Intuitive Surgical	3.483.604	0,19
Activision Blizzard	2.502.094	0,14
Hilton Worldwide	2.358.932	0,13
Krispy Kreme	2.318.098	0,13
CenterPoint Energy	2.207.447	0,12
Alphabet	2.207.117	0,12
ResMed	2.025.061	0,11
Phillips 66	1.941.151	0,11
Autres émetteurs	58.494.518	3,26
Total	86.814.461	4,83
World Gold Fund (en USD)		
United States Treasury	53.048.170	1,33
United Kingdom Gilt	41.798.927	1,05
French Republic Government	29.746.247	0,75
Australia Government	27.970.600	0,70
Kingdom of Belgium Government	25.305.444	0,64
Netherlands Government	18.404.825	0,46
Republic of Germany	17.068.541	0,43
Ireland Government	16.886.811	0,42
Microsoft	9.779.947	0,25
Spain Government	8.208.729	0,21
Autres émetteurs	154.101.429	3,87
Total	402.319.670	10,11
World Healthscience Fund (en USD)		
Horizon Therapeutics	27.045.171	0,20
United States Treasury	20.587.818	0,15
Kenvue	19.895.174	0,15
United Kingdom Gilt	19.196.396	0,14
Intuitive Surgical	17.857.856	0,13
Activision Blizzard	12.826.383	0,09
Hilton Worldwide	12.096.803	0,09
Krispy Kreme	11.883.169	0,09
CenterPoint Energy	11.315.943	0,08
ResMed	10.396.862	0,08
Autres émetteurs	349.083.868	2,56
Total	512.185.443	3,76
World Mining Fund (en USD)		
United States Treasury	43.438.628	0,80
United Kingdom Gilt	28.111.060	0,52
Microsoft	24.976.616	0,46
Netherlands Government	23.127.428	0,43
Republic of Germany	21.469.340	0,40
ING Groep	17.565.355	0,32
Chevron	15.935.945	0,29
Iberdrola	15.501.706	0,29
Pure Storage	12.033.680	0,22
Spain Government	10.185.135	0,19
Autres émetteurs	334.753.233	6,19
Total	547.098.126	10,11

Émetteur de la garantie autre qu'en numéraire	Valeur	% de la VNI du Compartiment
World Real Estate Securities Fund (en USD)		
United Kingdom Gilt	1.316.756	0,67
Alphabet	1.270.592	0,64
Republic of Germany	1.108.547	0,56
French Republic Government	1.013.354	0,51
Microsoft	880.370	0,44
United States Treasury	630.658	0,32
Amazon.com	615.502	0,31
Royal Bank of Canada	494.205	0,25
Pure Storage	421.707	0,21
Humana	378.542	0,19
Autres émetteurs	10.948.353	5,53
Total	19.078.586	9,63
World Technology Fund (en USD)		
Horizon Therapeutics	35.936.172	0,37
United States Treasury	28.831.681	0,29
Kenvue	26.567.869	0,27
Intuitive Surgical	23.847.248	0,24
Activision Blizzard	17.128.256	0,17
Hilton Worldwide	16.196.033	0,17
United Kingdom Gilt	16.944.918	0,17
Krispy Kreme	15.868.696	0,16
CenterPoint Energy	15.111.227	0,15
ResMed	13.862.694	0,14
Autres émetteurs	525.448.379	5,36
Total	735.743.173	7,49

(2) Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(3) Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(4) Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(5) Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

(7) Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

À la fin de l'exercice, aucune garantie en titres reçue d'un émetteur unique, en relation avec une gestion efficace du portefeuille et des opérations sur instruments dérivés de gré à gré, ne dépassait 20 % de la VL de chaque Compartiment concerné.

À la fin de l'exercice, aucun des Compartiments n'avait été pleinement garanti en titres émis ou garantis par un État membre de l'UE.

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé)

Le total des frais sur encours (« TFE ») correspond au total de tous les frais (en excluant les intérêts sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie, les frais de rendements négatifs sur actifs financiers, les frais d'opérations de dépositaire et les remboursements de frais) divisé par l'actif net moyen de la Société, exprimé en pourcentage. Toutes les données sont annualisées.

La commission de gestion peut être utilisée en partie pour payer la rémunération relative aux activités de distribution de la Société. Un remboursement peut être versé aux investisseurs institutionnels qui, d'un point de vue commercial, détiennent des actions de la Société pour des tiers.

Les TFE pour l'exercice allant du 1^{er} septembre 2022 au 31 août 2023 sont les suivants :

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Asian Dragon Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,846 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,845 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,846 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,845 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,845 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	1,844 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,845 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,096 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,095 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,094 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	1,090 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,096 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,095 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,345 %
	Action de distribution (A) de Catégorie I	0,834 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,829 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,836 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	0,830 %
	Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,103 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,085 %
Asian Growth Leaders Fund	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,835 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,835 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,835 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,835 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,835 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	1,085 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,085 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,084 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	1,085 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,085 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,335 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,825 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie I	0,824 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,824 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,935 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en CHF	0,935 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	0,935 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en GBP	0,935 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en SGD	0,935 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,074 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE	
Asian High Yield Bond Fund	Action de distribution (Q) de Catégorie A	1,173 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,211 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	1,211 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en GBP	1,211 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	1,211 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en SGD	1,211 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	1,211 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,211 %	
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,211 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,210 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,211 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,211 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,210 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,210 %	
	Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,710 %	
	Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,710 %	
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	0,710 %	
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,710 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,711 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,713 %	
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	1,711 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,710 %	
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,710 %	
	Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	0,550 %	
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,550 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,550 %	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,050 %	
	Asian Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,670 %
		Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	1,670 %
		Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	1,670 %
		Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	1,670 %
		Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	1,670 %
		Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	1,670 %
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD		1,670 %	
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en JPY		1,670 %	
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD		1,670 %	
Action de capitalisation de Catégorie A		1,670 %	
Action de capitalisation de Catégorie I		0,780 %	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,030 %		
Asian Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,860 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,050 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,360 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,790 %	
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,100 %	
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,630 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Asian Tiger Bond Fund	Action de distribution (D) de Catégorie A	1,213%
	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en HKD	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	1,209%
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en SGD	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	1,209%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,209%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1,209%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	1,212%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,213%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,213%
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,212%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,212%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,211%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,212%
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,463%
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,463%
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,715%
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,713%
	Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en HKD	0,713%
	Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en SGD	0,688%
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	0,712%
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,712%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,712%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	0,712%
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,712%
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,712%
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,553%
	Action de Catégorie I de distribution (M)	0,552%
	Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	0,552%
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,552%
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,552%
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SGD	0,552%
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,552%
	Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,615%
	Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,634%
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,612%
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,603%
	Action de Catégorie X de distribution (M)	0,012%
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,052%
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,022%	
Brown To Green Materials Fund ⁽²⁾	Action de capitalisation de Catégorie A	1,820%
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,820%
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,000%
	Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,320%
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,780%
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,099%
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,700%

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
China Bond Fund	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,010 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	1,016 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	1,005 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,009 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	1,006 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	1,007 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,004 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,006 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	1,004 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CAD	1,009 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,005 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en NZD	1,005 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,008 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	1,007 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,073 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,998 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,007 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,006 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,256 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,661 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,659 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	0,660 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	0,660 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	0,659 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,657 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	0,695 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,650 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,652 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie E	1,508 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	1,504 %
	Action de Catégorie E de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	1,506 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,507 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,504 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,517 %
	Action de Catégorie I de distribution (M)	0,502 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	0,499 %
	Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	0,499 %
	Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	0,511 %
	Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	0,499 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,491 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,502 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,508 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	0,953 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en USD	0,958 %
	Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,576 %
	Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,548 %
	Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,586 %
	Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,568 %
	Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	0,562 %
	Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	0,537 %
	Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,597 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,596 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,580 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,553 %
	Action de Catégorie X de distribution (M)	0,100 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,099 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD	0,100 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE	
China Flexible Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,885%	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,885%	
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,872%	
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,135%	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,113%	
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	2,386%	
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,386%	
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,386%	
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,845%	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,846%	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,125%	
	Action de capitalisation de Catégorie Z	0,895%	
China Fund			
		Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,826%
		Action de Catégorie A de distribution (T)	1,839%
		Action de capitalisation de Catégorie A	1,826%
		Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,826%
		Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,828%
		Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,826%
		Action de Catégorie A de capitalisation en HKD	1,826%
		Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,826%
		Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,816%
		Action de capitalisation de Catégorie C	3,076%
		Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,077%
		Action de capitalisation de Catégorie D	1,076%
		Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,077%
		Action de Catégorie D de capitalisation en HKD	1,076%
		Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	1,077%
		Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,076%
		Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,326%
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,815%	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,786%	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,065%	
China Impact Fund			
		Action de capitalisation de Catégorie A	1,879%
		Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,903%
		Action de capitalisation de Catégorie D	1,130%
		Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,129%
		Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,380%
		Action de capitalisation de Catégorie I	0,868%
		Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,843%
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,119%	
China Innovation Fund			
		Action de capitalisation de Catégorie A	1,820%
		Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,820%
		Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,000%
		Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	1,000%
		Action de capitalisation de Catégorie E	2,320%
		Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,740%
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,060%	
China Multi-Asset Fund⁽²⁾			
		Action de Catégorie A de distribution (T)	1,800%
		Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	1,800%
		Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	1,800%
		Action de capitalisation de Catégorie A	1,800%
		Action de capitalisation de Catégorie I	0,840%
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,090%	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
China Onshore Bond Fund⁽²⁾	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en HKD	1,223 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	1,222 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,221 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,253 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,730 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,760 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,561 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,604 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,061 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,100 %
	Action de Catégorie ZI de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	0,437 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,477 %
Circular Economy Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,810 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	1,796 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	1,809 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	1,810 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	1,810 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,810 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,810 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	1,810 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,810 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,810 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,810 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,810 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	1,798 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,810 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,810 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,042 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,990 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,310 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,730 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,730 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	0,730 %
	Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,910 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,910 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,910 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,050 %
	Action de capitalisation de Catégorie Z	0,688 %
Climate Action Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,820 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,820 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,070 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,000 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,320 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,740 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,060 %
Climate Action Multi-Asset Fund	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	1,518 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,578 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,553 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,816 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,999 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,074 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,778 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,162 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE	
Continental European Flexible Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,816 %	
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,816 %	
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,813 %	
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,816 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,812 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,816 %	
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,816 %	
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,064 %	
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,067 %	
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,064 %	
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	1,064 %	
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,067 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	1,064 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,067 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,064 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,315 %	
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,807 %	
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,807 %	
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,807 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,807 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,807 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,807 %	
	Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,914 %	
	Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,917 %	
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,914 %	
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,914 %	
	Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,058 %	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,059 %	
	Developed Markets Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,810 %
		Action de capitalisation de Catégorie D	0,940 %
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni		0,940 %	
Action de capitalisation de Catégorie E		2,310 %	
Action de capitalisation de Catégorie I		0,680 %	
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni		0,680 %	
Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni		0,050 %	
Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,500 %		

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE	
Dynamic High Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,767 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,767 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en EUR	1,741 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,767 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,767 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	1,767 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	1,767 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	1,767 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,767 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,767 %	
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,766 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,767 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,766 %	
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	1,766 %	
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,766 %	
	Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,016 %	
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	1,017 %	
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,016 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,044 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,016 %	
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	2,267 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,266 %	
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,266 %	
	Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G)	0,807 %	
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,782 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	0,806 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,806 %	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,057 %	
	Emerging Europe Fund ⁽³⁾	Action de distribution (A) de Catégorie A	0,414 %
		Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,414 %
Action de capitalisation de Catégorie A		0,414 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD		0,417 %	
Action de capitalisation de Catégorie C		0,414 %	
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni		0,414 %	
Action de capitalisation de Catégorie D		0,414 %	
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP		0,415 %	
Action de capitalisation de Catégorie E		0,414 %	
Action de capitalisation de Catégorie I		0,374 %	
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni		0,070 %	
Action de capitalisation de Catégorie X		0,070 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Emerging Markets Bond Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,470 %
	Action de distribution (D) de Catégorie A	1,470 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,470 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,470 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,470 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,470 %
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	1,470 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,470 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,710 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,710 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,870 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,870 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,870 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,870 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	1,970 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,970 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,970 %
	Action de distribution (A) de Catégorie I	0,710 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,703 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,667 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	0,710 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,710 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,710 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,676 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,683 %
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en CHF	0,060 %	
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en EUR	0,037 %	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,060 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,060 %	
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,690 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,690 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,690 %
	Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,965 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,964 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,963 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	2,190 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,190 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,190 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	0,780 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	0,780 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,780 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	0,761 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,780 %
	Action de Catégorie SR de distribution (M)	0,790 %
	Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,790 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,790 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,790 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,055 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY	0,055 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Emerging Markets Equity Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	1,868 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,869 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,868 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,884 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,868 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	1,877 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	1,870 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	1,878 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,869 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,869 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,868 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,883 %
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	1,850 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,873 %
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,118 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,118 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,104 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,118 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	2,369 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,369 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,858 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	0,874 %
	Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	0,066 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,104 %
	Emerging Markets Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A
Action de capitalisation de Catégorie A		1,881 %
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR		1,893 %
Action de capitalisation de Catégorie AI		1,876 %
Action de capitalisation de Catégorie C		3,130 %
Action de capitalisation de Catégorie D		1,134 %
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR		1,139 %
Action de capitalisation de Catégorie E		2,381 %
Action de distribution (A) de Catégorie I		0,871 %
Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni		0,871 %
Action de capitalisation de Catégorie I		0,872 %
Action de capitalisation de Catégorie SI		0,774 %
Action de capitalisation de Catégorie X		0,119 %
Emerging Markets Impact Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,048 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,625 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,621 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,510 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,461 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,461 %
	Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	0,062 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,032 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,061 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,489 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,236 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,273 %
	Action de distribution (D) de Catégorie A	1,271 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,271 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	1,271 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,271 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,271 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,271 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	1,271 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	1,271 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,272 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,271 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,269 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,271 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,269 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	1,269 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,270 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,268 %
	Action de Catégorie AI de distribution (Q)	1,270 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,274 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,520 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,520 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	0,774 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,771 %
	Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en AUD	0,729 %
	Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,771 %
	Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,771 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,770 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,771 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,770 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	0,770 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	0,763 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,770 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	1,770 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,770 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,770 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie I	0,610 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,610 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,610 %
	Action de distribution (M) de Catégorie S	0,656 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,662 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	0,672 %
	Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,743 %
	Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,715 %
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,720 %	
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,724 %	
Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en GBP	0,081 %	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,110 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	0,112 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Emerging Markets Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,851 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,044 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,044 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,354 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,790 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,090 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	0,100 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,090 %
ESG Flex Choice Cautious Fund	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,630 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,550 %
Action de capitalisation de Catégorie I	0,470 %	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,070 %	
ESG Flex Choice Growth Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	0,976 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	0,965 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	0,976 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,550 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,470 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,070 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
ESG Flex Choice Moderate Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en GBP	0,990 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	0,990 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,550 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,470 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,070 %
ESG Global Conservative Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	1,289 %
	Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G)	1,287 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,271 %
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G)	1,287 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,286 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	0,810 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,785 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	1,787 %
	Action de Catégorie E de distribution (S) (M) (G)	1,787 %
	Action de Catégorie E de distribution (Y) (Q) (G)	1,787 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,787 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,546 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,075 %
	ESG Global Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (M) (G)
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)		1,769 %
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR		1,770 %
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD		1,770 %
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD		1,770 %
Action de capitalisation de Catégorie A		1,770 %
Action de capitalisation de Catégorie D		0,810 %
Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR		2,238 %
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR		2,270 %
Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) couverte en GBP		0,060 %
Action de capitalisation de Catégorie X		0,060 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
ESG Multi-Asset Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,516 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en SGD	1,505 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	1,506 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	1,456 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en SGD	1,505 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en USD	1,506 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,516 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,506 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,505 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,505 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en ZAR	1,505 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,516 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,766 %
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en USD	2,755 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,966 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,955 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,016 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en USD	2,005 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,756 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	0,755 %
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,757 %	
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund ⁽⁴⁾	Action de capitalisation de Catégorie A	0,710 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	0,710 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,399 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,210 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,250 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	0,239 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,250 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,045 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	0,050 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,050 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Euro Bond Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	0,972 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,972 %
	Action de distribution (D) de Catégorie A	0,971 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	0,972 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,972 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	0,969 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	0,970 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	0,972 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	0,972 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,222 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	0,622 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,622 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,622 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,622 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,622 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,622 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,621 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie E	1,472 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,472 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,462 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,462 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,462 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,462 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	0,462 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	0,462 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,462 %
	Action de Catégorie S de distribution (A)	0,522 %
	Action de distribution (M) de Catégorie S	0,544 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,533 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,523 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,522 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,062 %
	Euro Corporate Bond Fund	Action de distribution (D) de Catégorie A
Action de distribution (M) de Catégorie A		1,024 %
Action de capitalisation de Catégorie A		1,024 %
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF		1,024 %
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP		1,024 %
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK		1,024 %
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD		1,023 %
Action de capitalisation de Catégorie AI		1,024 %
Action de capitalisation de Catégorie C		2,274 %
Action de distribution (M) de Catégorie D		0,624 %
Action de capitalisation de Catégorie D		0,624 %
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF		0,624 %
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP		0,624 %
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD		0,624 %
Action de distribution (Q) de Catégorie E		1,524 %
Action de capitalisation de Catégorie E		1,524 %
Action de distribution (Q) de Catégorie I		0,464 %
Action de capitalisation de Catégorie I		0,464 %
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF		0,426 %
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP		0,463 %
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY		0,464 %
Action de Catégorie X de distribution (Q)		0,064 %
Action de capitalisation de Catégorie X		0,064 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE	
Euro Reserve Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	0,554 %	
	Action de capitalisation de Catégorie C	0,561 %	
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,367 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	0,804 %	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,080 %	
Euro Short Duration Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,894 %	
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,894 %	
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,894 %	
	Action de distribution (D) de Catégorie A	0,893 %	
	Action de distribution (M) de Catégorie A	0,893 %	
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,893 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	0,893 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	0,893 %	
	Action de capitalisation de Catégorie AI	0,893 %	
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,143 %	
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,544 %	
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,544 %	
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,544 %	
	Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,543 %	
	Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,544 %	
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,543 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,543 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	0,543 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,393 %	
	Action de distribution (Q) de Catégorie I	0,458 %	
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,458 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	0,459 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,458 %	
	Action de Catégorie S de distribution (A)	0,461 %	
	Action de distribution (M) de Catégorie S	0,475 %	
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,441 %	
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en USD	0,431 %	
	Action de capitalisation de Catégorie SI	0,328 %	
	Action de Catégorie SI de capitalisation couverte en USD	0,328 %	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,058 %	
	Euro-Markets Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,819 %
		Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,818 %
Action de capitalisation de Catégorie A		1,819 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF		1,819 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP		1,819 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD		1,820 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD		1,820 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD		1,819 %	
Action de capitalisation de Catégorie AI		1,817 %	
Action de capitalisation de Catégorie C		3,068 %	
Action de distribution (A) de Catégorie D		1,071 %	
Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni		1,070 %	
Action de capitalisation de Catégorie D		1,070 %	
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD		1,070 %	
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni		1,070 %	
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF		1,070 %	
Action de capitalisation de Catégorie E		2,319 %	
Action de distribution (A) de Catégorie I		0,810 %	
Action de capitalisation de Catégorie I		0,808 %	
Action de Catégorie S de distribution (A)		0,921 %	
Action de capitalisation de Catégorie S		0,920 %	
Action de capitalisation de Catégorie X		0,055 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
European Equity Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	1,824 %
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	1,822 %
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en USD	1,822 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,823 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	1,823 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,824 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,822 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en USD	1,822 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,822 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	1,822 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,823 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,823 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	1,822 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,822 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,822 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,822 %
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G)	1,821 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,822 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	1,074 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,074 %
	Action de Catégorie D de distribution (M) (G)	1,065 %
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,074 %
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,072 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,073 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en USD	1,075 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,073 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,073 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	1,074 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	2,322 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,322 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	0,815 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,812 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,812 %
Action de Catégorie SR de distribution (A) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,922 %	
Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,923 %	
Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,063 %	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,064 %	
European Focus Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,836 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,833 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,835 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,833 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,084 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,070 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,070 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,335 %
Action de capitalisation de Catégorie I	0,810 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
European Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,813 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,813 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,813 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,812 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,061 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,064 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,063 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	1,063 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,063 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,312 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,804 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en USD	0,804 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,913 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,055 %	
European High Yield Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,216 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,217 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,216 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	0,769 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,769 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,767 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie E	1,717 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,716 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,057 %
	Action de capitalisation de Catégorie Z	0,467 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en USD	0,467 %
European Special Situations Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,829 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,829 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,828 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	1,828 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,826 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,829 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,827 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,829 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,077 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,080 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	1,079 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,328 %
	Action de distribution (A) de Catégorie I	0,790 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,820 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,071 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
European Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,810 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,810 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,310 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,730 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,050 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,550 %
European Value Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,816 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,816 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,815 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,815 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,817 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,814 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,815 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,064 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,067 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,066 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en USD	1,066 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,314 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,806 %
	Action de Catégorie S de distribution (A)	0,917 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,057 %
FinTech Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,815 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,815 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,815 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,815 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,815 %
	Action de Catégorie C de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	3,065 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,996 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,996 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,996 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,996 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,315 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,315 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,713 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,735 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,736 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,057 %	
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,696 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Fixed Income Global Opportunities Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,217 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	1,218 %
	Action de distribution (D) de Catégorie A	1,216 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	1,232 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,216 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie A	1,216 %
	Action de Catégorie A de distribution (Q) couverte en EUR	1,216 %
	Action de Catégorie A de distribution (Q) couverte en SGD	1,216 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,216 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,217 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,216 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,216 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,216 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,216 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,216 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	1,216 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	1,216 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,217 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,216 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,216 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,216 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,216 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,467 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie C	2,466 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,466 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	0,718 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en CAD	0,718 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	0,718 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,718 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie D	0,716 %
	Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en CHF	0,716 %
	Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en EUR	0,716 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,716 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,716 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,716 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	0,716 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	0,716 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	0,715 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,716 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,716 %
	Action de Catégorie I de distribution (M) couverte en CAD	0,556 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie I	0,557 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en EUR	0,556 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en GBP	0,557 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) couverte en JPY	0,556 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,556 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en AUD	0,556 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	0,554 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CHF	0,556 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,556 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en GBP	0,556 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	0,556 %
	Action de distribution (M) de Catégorie J	0,056 %
	Action de Catégorie S de distribution (A) couverte en EUR	0,618 %
	Action de Catégorie S de distribution (Q)	0,616 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,616 %
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en CHF	0,616 %	
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	0,616 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
	Action de Catégorie X de distribution (M)	0,056 %
	Action de Catégorie X de distribution (M) couverte en AUD	0,056 %
	Action de Catégorie X de distribution (M) couverte en EUR	0,056 %
	Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en EUR	0,056 %
	Action de Catégorie X de distribution (Q) couverte en GBP	0,056 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,056 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	0,056 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CAD	0,056 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF	0,014 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,014 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	0,057 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK	0,026 %
Future Consumer Fund		
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,820 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,820 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,000 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,000 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,320 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,740 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,740 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,060 %
	Action de capitalisation de Catégorie Z	0,700 %
Future Of Transport Fund		
	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,813 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,813 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	1,815 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,813 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,813 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,813 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,813 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,813 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,043 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,994 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,994 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,994 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,312 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,313 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,735 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,734 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,735 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,055 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,695 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Global Allocation Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,771 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	1,771 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	1,779 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en AUD	1,772 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en CNH	1,763 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en EUR	1,732 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en HKD	1,762 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en SGD	1,771 %
	Action de Catégorie A de distribution (T) couverte en ZAR	1,751 %
	Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G)	1,740 %
	Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G) couverte en AUD	1,775 %
	Action de Catégorie A de distribution (Y) (Q) (G) couverte en SGD	1,770 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,770 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,770 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,770 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,770 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,768 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,770 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,769 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	1,769 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,770 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,770 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,770 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,020 %
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	3,020 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	1,021 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	1,021 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,020 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	1,020 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,020 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,020 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	1,020 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	1,021 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	1,021 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,020 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,270 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,270 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en PLN	2,269 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,810 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,808 %
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SGD	1,080 %	
Action de capitalisation de Catégorie J	0,061 %	
Action de capitalisation de Catégorie S	0,912 %	
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	0,908 %	
Action de distribution (A) de Catégorie X	0,061 %	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,061 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	0,060 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,034 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY	0,060 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE	
Global Corporate Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	1,115 %	
	Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	1,089 %	
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CAD	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	1,114 %	
	Action de distribution (Q) de Catégorie A	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,114 %	
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,114 %	
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,114 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,114 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,114 %	
	Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en GBP	0,614 %	
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,664 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,664 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,664 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,614 %	
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,614 %	
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,504 %	
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,504 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	0,527 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,504 %	
	Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,017 %	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,054 %	
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,054 %	
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	0,054 %	
	Global Dynamic Equity Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,821 %
		Action de capitalisation de Catégorie A	1,821 %
		Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,820 %
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR		1,821 %	
Action de capitalisation de Catégorie C		3,070 %	
Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR		3,070 %	
Action de distribution (A) de Catégorie D		1,072 %	
Action de capitalisation de Catégorie D		1,072 %	
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR		1,071 %	
Action de capitalisation de Catégorie E		2,321 %	
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR		2,321 %	
Action de capitalisation de Catégorie I		0,811 %	
Action de capitalisation de Catégorie X		0,023 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Global Equity Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	1,815%
	Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR	1,815%
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en EUR	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en CNH	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,814%
	Action de Catégorie A de distribution (T)	1,815%
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,814%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,814%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,814%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	1,814%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,814%
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	1,814%
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,814%
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,815%
	Action de Catégorie C de distribution (Q) (G)	3,063%
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,063%
	Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	1,066%
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G)	1,064%
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) couverte en EUR	1,065%
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,064%
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,064%
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,064%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,065%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,064%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	1,064%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	1,065%
	Action de Catégorie E de distribution (Q) (G)	2,313%
	Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	2,314%
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,313%
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,314%
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,805%
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,805%
Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G)	0,899%	
Action de capitalisation de Catégorie SR	0,896%	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,018%	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Global Government Bond Fund	Action de distribution (D) de Catégorie A	0,976 %
	Action de Catégorie A de distribution (D) couverte en EUR	0,974 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	0,976 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	0,976 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	0,976 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en HKD	0,976 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,976 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	0,976 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,227 %
	Action de Catégorie C de distribution (D) couverte en EUR	2,228 %
	Action de distribution (M) de Catégorie C	0,019 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,226 %
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	2,226 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,626 %
	Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en EUR	0,628 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,626 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,626 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,476 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,476 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	0,460 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,464 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,465 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,066 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	0,066 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK	0,066 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,066 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Global High Yield Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (D) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,460 %
	Action de Catégorie A de distribution (D) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,460 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,460 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	1,460 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie A	1,460 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,460 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1,460 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,460 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,460 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,460 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,460 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,460 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,460 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	1,459 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,460 %
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	1,460 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,460 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,710 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,709 %
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	2,710 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,760 %
	Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en EUR	0,760 %
	Action de Catégorie D de distribution (Q) couverte en GBP	0,760 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,760 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,760 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,760 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	1,960 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,960 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,960 %
	Action de Catégorie I de distribution (M)	0,600 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,600 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en CAD	0,618 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,600 %
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,575 %	
Action de Catégorie X de distribution (A) couverte en EUR	0,051 %	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,050 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,050 %	
Global Inflation Linked Bond Fund	Action de distribution (M) de Catégorie A	0,975 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,975 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	0,975 %
	Action de distribution (M) de Catégorie C	2,226 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,226 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,620 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,620 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,620 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,475 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,460 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,060 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Global Long-Horizon Equity Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,811 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,811 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,811 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,811 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,811 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,060 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,062 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,062 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,311 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,802 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,052 %
Global Multi-Asset Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	1,797 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en CHF	1,789 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en EUR	1,788 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	1,794 %
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	1,794 %
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en AUD	1,786 %
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en SGD	1,786 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,785 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	1,786 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,786 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en GBP	1,785 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,785 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,793 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	1,785 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,786 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,786 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,793 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,785 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,785 %
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) (G) couverte en EUR	1,782 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,785 %
	Action de Catégorie C de distribution (S) (M) (G)	3,043 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,043 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en CHF	0,888 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en EUR	0,888 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	0,894 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en GBP	0,886 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	0,880 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,893 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,876 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,885 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	2,285 %
	Action de Catégorie E de distribution (Y) (Q) (G) couverte en EUR	2,285 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,293 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,284 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) (G) couverte en EUR	0,683 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,683 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,684 %
	Action de Catégorie X de distribution (Q) (G) couverte en GBP	0,054 %
	Action de Catégorie X de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	0,084 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,080 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Impact Bond Fund⁽²⁾	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,967 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,594 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,494 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,410 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,079 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD	0,050 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,463 %
	Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,279 %
India Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,850 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,850 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,099 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,101 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,100 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,350 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,841 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,093 %
Japan Flexible Equity Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,813 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,813 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,818 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,817 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,068 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,068 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,066 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,065 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,315 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,315 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,808 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,055 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,077 %
Japan Small & MidCap Opportunities Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,816 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,816 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,816 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en USD	1,816 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,066 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,070 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,069 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,069 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,318 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,811 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,790 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,057 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Latin American Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	2,085 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,085 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	2,083 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	2,083 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	2,084 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	2,083 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	2,082 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	2,083 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,333 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	1,336 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,337 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,333 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,334 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,334 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	1,334 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	1,328 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,335 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,582 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	1,073 %
	Action de capitalisation de Catégorie J	0,074 %
Action de Catégorie X de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,045 %	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,074 %	
Multi-Theme Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,497 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,500 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,500 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,747 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,800 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,797 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,997 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,058 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	0,088 %
Action de capitalisation de Catégorie Z	0,597 %	
Natural Resources Fund⁽⁷⁾	Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	1,816 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	1,817 %
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	1,815 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,815 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,815 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,066 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,065 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	2,315 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,314 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	0,806 %
	Action de Catégorie S de distribution (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,963 %
	Action de Catégorie S de distribution (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,988 %
	Action de Catégorie S de distribution (Q) (G)	0,986 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,986 %
	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,986 %
	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,987 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Next Generation Health Care Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,820 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,820 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,820 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,820 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,000 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,000 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,320 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,740 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,740 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,060 %
	Action de capitalisation de Catégorie Z	0,700 %
Next Generation Technology Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,812 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,812 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	1,809 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,807 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,811 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	1,818 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,812 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,812 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,042 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,993 %
	Action de capitalisation de Catégorie D couverte en CNH	0,993 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,994 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	0,993 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,993 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,993 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,312 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,312 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,734 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,734 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,733 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,734 %
	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,913 %
	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,913 %
	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,913 %
	Action de Catégorie S de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,913 %
	Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,913 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,914 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,886 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,054 %
Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,693 %	
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,693 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Nutrition Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	1,817 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,819 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,817 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,816 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,817 %
	Action de Catégorie A de capitalisation en HKD	1,817 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	1,816 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,817 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,816 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,066 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) couverte en EUR	0,997 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,997 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,997 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,996 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	0,997 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,997 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,316 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,710 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,737 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY	0,737 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,057 %	
Sustainable Asian Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,249 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,234 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,733 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,778 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,732 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,568 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK	0,571 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,073 %
	Action de capitalisation de Catégorie Z	0,572 %
	Action de Catégorie ZI de distribution (S) (M) (G)	0,403 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,435 %
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,720 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,720 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,720 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,720 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,970 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,970 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,970 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	2,220 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,220 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,810 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,810 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,060 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,460 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,620 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Sustainable Emerging Markets Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,470 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	1,470 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,470 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,470 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,470 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,470 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,870 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,870 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,870 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,870 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,865 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	1,970 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,970 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,710 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,710 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en NOK	0,690 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,060 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD	0,060 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,060 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,526 %
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,690 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,690 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,690 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,690 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,690 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,970 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,970 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,970 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	2,190 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,190 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,810 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,810 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,060 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,586 %
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,285 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,283 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,281 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,284 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,810 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,783 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,786 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	1,786 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,785 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,625 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,603 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,126 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,487 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE	
Sustainable Energy Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,966 %	
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,966 %	
	Action de Catégorie A de distribution (T)	1,969 %	
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,966 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,954 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CAD	1,953 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,954 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,954 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	1,954 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,954 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en NZD	1,953 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,954 %	
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,966 %	
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,215 %	
	Action de distribution (A) de Catégorie D	1,217 %	
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,217 %	
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,217 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	1,205 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,466 %	
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,453 %	
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,957 %	
	Action de distribution (Q) de Catégorie I	0,957 %	
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,957 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,957 %	
	Action de Catégorie S de distribution (A)	1,027 %	
	Action de capitalisation de Catégorie S	1,017 %	
	Action de Catégorie X de distribution (T)	0,058 %	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,058 %	
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,058 %	
	Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,218 %
		Action de capitalisation de Catégorie AI	1,215 %
		Action de capitalisation de Catégorie D	0,716 %
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF		0,698 %	
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD		0,693 %	
Action de capitalisation de Catégorie E		1,716 %	
Action de capitalisation de Catégorie I		0,556 %	
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en JPY		0,556 %	
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en SEK		0,556 %	
Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en USD		0,556 %	
Action de Catégorie X de distribution (M)		0,056 %	
Action de Catégorie X de distribution (Q)		0,056 %	
Action de capitalisation de Catégorie X		0,056 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF		0,026 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP		0,053 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en JPY		0,056 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en SEK		0,056 %	
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en USD		0,026 %	
Action de capitalisation de Catégorie ZI		0,373 %	
Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en USD		0,380 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Sustainable Global Allocation Fund⁽²⁾	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,600 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SEK	1,600 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,600 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,600 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,950 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,950 %
	Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,100 %
	Action de Catégorie E de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	2,100 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,740 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,739 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,040 %
	Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,581 %
	Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,579 %
Sustainable Global Bond Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	1,246 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	1,227 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,226 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en AUD	1,229 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CAD	1,203 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,226 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,222 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	1,224 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en NZD	1,226 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	1,226 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,227 %
	Action de Catégorie AI de distribution (Q) couverte en EUR	1,225 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,226 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,224 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,725 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,710 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,778 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,725 %
	Action de Catégorie E de distribution (Q) couverte en EUR	1,726 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,725 %
	Action de Catégorie I de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	0,566 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,565 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	0,565 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,558 %
	Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	0,036 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,065 %
	Action de capitalisation de Catégorie Z	0,465 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en CHF	0,465 %
	Action de Catégorie Z de capitalisation couverte en EUR	0,465 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,407 %
	Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR	0,414 %
	Sustainable Global Infrastructure Fund	Action de capitalisation de Catégorie A
Action de capitalisation de Catégorie AI		1,607 %
Action de capitalisation de Catégorie D		1,008 %
Action de capitalisation de Catégorie E		2,108 %
Action de capitalisation de Catégorie I		0,719 %
Action de capitalisation de Catégorie X		0,147 %
Action de capitalisation de Catégorie Z		0,689 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Sustainable World Bond Fund⁽⁴⁾	Action de distribution (D) de Catégorie A	1,072 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,072 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,072 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,072 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,072 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,072 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,072 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,322 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,672 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,672 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,672 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,672 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,672 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,572 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) couverte en EUR	0,512 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,512 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,062 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en CHF	0,019 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en DKK	0,032 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,061 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	0,061 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NOK	0,062 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en NZD	0,072 %
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund⁽⁵⁾	Action de capitalisation de Catégorie A	1,814 %
	Action de Catégorie D de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,064 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,064 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,805 %
Systematic China A-Share Opportunities Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,835 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,835 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	1,857 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,085 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,085 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,085 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,339 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,825 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,825 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,940 %
	Action de capitalisation de Catégorie SR	0,937 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,075 %	
Action de capitalisation de Catégorie Z	0,838 %	
Systematic China Environmental Tech Fund⁽²⁾	Action de capitalisation de Catégorie A	1,900 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,080 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,080 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,820 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,140 %
	Action de capitalisation de Catégorie Z	0,900 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,650 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Systematic Global Equity High Income Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) (G)	1,821%
	Action de Catégorie A de distribution (A) (G) couverte en CHF	1,815%
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G)	1,816%
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) couverte en EUR	1,810%
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	1,811%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,810%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CAD	1,811%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH	1,811%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en NZD	1,811%
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1,794%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,816%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en EUR	1,805%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,811%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,811%
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,811%
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,815%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,810%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	1,805%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,810%
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	1,810%
	Action de Catégorie C de distribution (Q) (G)	3,065%
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,065%
	Action de Catégorie D de distribution (A) (G)	0,921%
	Action de Catégorie D de distribution (A) (G) couverte en CHF	0,915%
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G)	0,916%
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,911%
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,911%
	Action de Catégorie D de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,911%
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	0,918%
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	0,911%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,910%
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,916%
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,911%
	Action de Catégorie E de distribution (Q) (G) couverte en EUR	2,310%
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,316%
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,310%
	Action de Catégorie I de distribution (A) (G)	0,658%
	Action de Catégorie I de distribution (M) (G)	0,656%
	Action de Catégorie I de distribution (Q) (G)	0,657%
	Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,657%
	Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,656%
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,655%
	Action de Catégorie SR de distribution (S) (M) (G)	0,912%
Action de capitalisation de Catégorie SR	0,891%	
Action de capitalisation de Catégorie X	0,057%	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund⁽²⁾		
	Action de Catégorie A de distribution (Q) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,770 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,770 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	1,770 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en HKD	1,770 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en SGD	1,770 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,770 %
	Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)	1,020 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,020 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,020 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,270 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,810 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,810 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,060 %
	Action de Catégorie ZI de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,560 %
Systematic Sustainable Global SmallCap Fund⁽⁴⁾		
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,833 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,833 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,081 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,083 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,332 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	0,075 %
United Kingdom Fund		
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,813 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,812 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,062 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,064 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,063 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,063 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,312 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,803 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,803 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,053 %
US Basic Value Fund		
	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,812 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,811 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	1,816 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,812 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,813 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,811 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,811 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,061 %
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	3,061 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	1,063 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,063 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,063 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,063 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,312 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,312 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,803 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,054 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
US Dollar Bond Fund	Action de distribution (D) de Catégorie A	1,070 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,070 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,070 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,320 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,320 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,670 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,669 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,669 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,570 %
	Action de distribution (Q) de Catégorie I	0,510 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,509 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,509 %
	Action de Catégorie X de distribution (Q)	0,029 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,059 %	
US Dollar High Yield Bond Fund	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,463 %
	Action de distribution (D) de Catégorie A	1,460 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	1,460 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en AUD	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CAD	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en EUR	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en GBP	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en NZD	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en SGD	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en AUD	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en ZAR	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CNH	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD	1,461 %
	Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD	1,461 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,460 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,460 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	1,460 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,460 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,460 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,710 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,710 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,764 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,761 %
	Action de Catégorie D de distribution (M) couverte en SGD	0,761 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en AUD	0,760 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	0,760 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,760 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	0,760 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,760 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,960 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	1,960 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,601 %
	Action de Catégorie I de distribution (M)	0,601 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,600 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,600 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en CHF	0,567 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,590 %
	Action de Catégorie SR de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,643 %
	Action de Catégorie SR de distribution (M) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,711 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,710 %
	Action de Catégorie SR de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	0,710 %
	Action de Catégorie X de distribution (S) (M) (G)	0,051 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,051 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
US Dollar Reserve Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	0,546%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en GBP	0,546%
	Action de capitalisation de Catégorie C	0,546%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en GBP	0,346%
	Action de capitalisation de Catégorie E	0,796%
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en GBP	0,796%
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,051%
US Dollar Short Duration Bond Fund	Action de distribution (D) de Catégorie A	0,887%
	Action de Catégorie A de distribution (M) (G)	0,866%
	Action de distribution (M) de Catégorie A	0,887%
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en CNH	0,884%
	Action de Catégorie A de distribution (M) couverte en SGD	0,887%
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,887%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	0,886%
	Action de capitalisation de Catégorie AI	0,887%
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,137%
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,137%
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,537%
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,537%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	0,537%
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,387%
	Action de distribution (Q) de Catégorie I	0,405%
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,452%
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,452%
	Action de distribution (M) de Catégorie S	0,500%
	Action de capitalisation de Catégorie S	0,497%
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	0,536%
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,052%
US Flexible Equity Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,811%
	Action de Catégorie A de distribution (A) couverte en EUR	1,811%
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,810%
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,810%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,813%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CZK	1,814%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,810%
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	1,811%
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,810%
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,059%
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	3,059%
	Action de distribution (A) de Catégorie D	1,062%
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,061%
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,061%
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,061%
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,310%
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,310%
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,802%
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,803%
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,053%
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,073%	
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en GBP	0,026%

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
US Government Mortgage Impact Fund	Action de distribution (D) de Catégorie A	0,973 %
	Action de distribution (M) de Catégorie A	0,974 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	0,973 %
	Action de distribution (D) de Catégorie C	2,224 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	2,224 %
	Action de distribution (M) de Catégorie D	0,623 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,623 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	1,474 %
	Action de Catégorie I de distribution (M)	0,409 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,463 %
	Action de Catégorie X de distribution (M)	0,032 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,312 %
	Action de Catégorie ZI de capitalisation couverte en EUR	0,310 %
US Growth Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,809 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,809 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	1,808 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,809 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,809 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,057 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	1,061 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,061 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,061 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,309 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,801 %
		Action de capitalisation de Catégorie X
US Mid-Cap Value Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,813 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,814 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,062 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,064 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,313 %
		Action de capitalisation de Catégorie I
US Sustainable Equity Fund	Action de capitalisation de Catégorie A	1,810 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	0,990 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,990 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,310 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,730 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,730 %
	Action de Catégorie X de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,050 %
	Action de capitalisation de Catégorie ZI	0,550 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
World Energy Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	2,061 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,061 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	2,061 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	2,060 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	2,060 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	2,060 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	2,060 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	2,060 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	2,060 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	2,060 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,309 %
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	3,309 %
	Action de distribution (A) de Catégorie D	1,312 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,312 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,311 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,311 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,311 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,560 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,560 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,048 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	1,052 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1,051 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	1,111 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	1,111 %
	Action de Catégorie X de distribution (T)	0,051 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,052 %
	World Financials Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A
Action de Catégorie A de distribution (T)		1,874 %
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD		1,845 %
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD		1,847 %
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni		1,846 %
Action de capitalisation de Catégorie AI		1,848 %
Action de capitalisation de Catégorie C		3,096 %
Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni		1,097 %
Action de capitalisation de Catégorie E		2,347 %
Action de capitalisation de Catégorie I		0,848 %
Action de capitalisation de Catégorie S		0,973 %
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR		0,955 %
Action de Catégorie X de distribution (T)		0,086 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,090 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE	
World Gold Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	2,063 %	
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,063 %	
	Action de Catégorie A de distribution (T)	2,069 %	
	Action de capitalisation de Catégorie A	2,063 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	2,063 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	2,063 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	2,063 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	2,063 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	2,063 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	2,063 %	
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,063 %	
	Action de capitalisation de Catégorie AI	2,062 %	
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	2,063 %	
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,311 %	
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	3,312 %	
	Action de distribution (A) de Catégorie D	1,314 %	
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,314 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,314 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,314 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	1,314 %	
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,314 %	
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,562 %	
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,563 %	
	Action de capitalisation de Catégorie I	1,054 %	
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1,055 %	
	Action de capitalisation de Catégorie S	1,064 %	
	Action de Catégorie X de distribution (T)	0,026 %	
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,055 %	
	World Healthscience Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,814 %
		Action de Catégorie A de distribution (T)	1,812 %
Action de capitalisation de Catégorie A		1,814 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD		1,783 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH		1,783 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD		1,783 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY		1,783 %	
Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD		1,783 %	
Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR		1,783 %	
Action de capitalisation de Catégorie AI		1,814 %	
Action de capitalisation de Catégorie C		3,063 %	
Action de distribution (A) de Catégorie D		1,064 %	
Action de Catégorie D de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni		1,064 %	
Action de capitalisation de Catégorie D		1,064 %	
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR		1,033 %	
Action de capitalisation de Catégorie E		2,313 %	
Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR		2,283 %	
Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni		0,774 %	
Action de capitalisation de Catégorie I		0,804 %	
Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR		0,804 %	
Action de capitalisation de Catégorie S		0,909 %	
Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR		0,879 %	
Action de Catégorie X de distribution (T)		0,054 %	
Action de capitalisation de Catégorie X		0,056 %	

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
World Mining Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	2,065 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	2,065 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	2,067 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	2,064 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	2,065 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CHF	2,065 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en EUR	2,065 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en HKD	2,064 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en PLN	2,064 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	2,065 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	2,064 %
	Action de Catégorie AI de capitalisation couverte en EUR	2,064 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,313 %
	Action de Catégorie C de capitalisation couverte en EUR	3,314 %
	Action de Catégorie D de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,317 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,315 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF	1,315 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,315 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en PLN	1,315 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en SGD	1,316 %
	Action de Catégorie D de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	1,315 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,564 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,564 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,057 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	1,056 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	1,054 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,056 %
	Action de capitalisation de Catégorie S	1,116 %
	Action de Catégorie S de capitalisation couverte en EUR	1,116 %
	Action de Catégorie X de distribution (T)	0,057 %
	Action de capitalisation de Catégorie X	0,057 %
	Action de Catégorie X de capitalisation couverte en EUR	0,026 %
	World Real Estate Securities Fund	Action de Catégorie A de distribution (R) (M) (G) couverte en CNH
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G)		1,830 %
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en HKD		1,833 %
Action de Catégorie A de distribution (S) (M) (G) couverte en SGD		1,831 %
Action de Catégorie A de distribution (T)		1,831 %
Action de capitalisation de Catégorie A		1,830 %
Action de Catégorie D de distribution (S) (M) (G)		1,066 %
Action de capitalisation de Catégorie D		1,081 %
Action de Catégorie D de capitalisation couverte en CHF		1,080 %
Action de capitalisation de Catégorie E		2,330 %
Action de Catégorie X de distribution (Q)		0,057 %
Action de Catégorie X de distribution (T)		0,070 %
Action de capitalisation de Catégorie X		0,070 %
Action de Catégorie X de capitalisation couverte en AUD		0,070 %

Appendice V – Total des frais sur encours (non révisé) suite

Nom du Compartiment	Catégorie d'Actions	TFE
World Technology Fund	Action de distribution (A) de Catégorie A	1,809 %
	Action de Catégorie A de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	1,809 %
	Action de Catégorie A de distribution (T)	1,808 %
	Action de capitalisation de Catégorie A	1,809 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en AUD	1,791 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en CNH	1,791 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en JPY	1,787 %
	Action de Catégorie A de capitalisation couverte en SGD	1,791 %
	Action de Catégorie A de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en EUR	1,791 %
	Action de capitalisation de Catégorie AI	1,809 %
	Action de capitalisation de Catégorie C	3,057 %
	Action de capitalisation de Catégorie D	1,060 %
	Action de Catégorie D de capitalisation couverte en EUR	1,042 %
	Action de capitalisation de Catégorie E	2,308 %
	Action de Catégorie E de capitalisation couverte en EUR	2,289 %
	Action de Catégorie I de distribution (A) de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,801 %
	Action de Catégorie I de distribution (Q) de fonds déclarant au Royaume-Uni couverte en GBP	0,800 %
	Action de capitalisation de Catégorie I	0,800 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en BRL	0,800 %
	Action de Catégorie I de capitalisation couverte en EUR	0,801 %
	Action de Catégorie I de capitalisation de fonds déclarant au Royaume-Uni	0,800 %
	Action de Catégorie X de distribution (T)	0,052 %
Action de capitalisation de Catégorie X	0,052 %	

⁽²⁾ Compartiment lancé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽³⁾ Compartiment suspendu, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁴⁾ Le nom du Compartiment a été changé au cours de l'exercice, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁵⁾ Compartiment fermé aux souscriptions, voir point 1 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

⁽⁷⁾ Le Compartiment a été rebaptisé après la fin de l'exercice, voir point 19 de l'Annexe aux états financiers pour de plus amples informations.

Appendice VI – Publication d'informations en matière de durabilité (non révisé)

Glossaire et définitions clés

Les informations du rapport périodique présentées ci-dessous portent sur l'exercice clos le 31 août 2023, la « période de référence ».

Toutes les données présentées pour les investissements du Compartiment et les autres mesures quantitatives divulguées ont été calculées sur la base d'une moyenne de la valeur des investissements négociés et détenus à chaque date de fin de trimestre de la période de référence pour laquelle les Compartiments concernés remplissaient les critères d'un Fonds au sens de l'Article 8 ou 9. Pour les mesures présentées avec des indicateurs de durabilité, le calcul de la mesure correspondante porte sur les investissements avec des données ESG sous-jacentes disponibles, et non sur tous les investissements détenus par le Compartiment.

Ces données n'ont pas été révisées, l'auditeur du Compartiment n'a pas fourni de garantie les concernant et elles n'ont été contrôlées par aucun tiers.

Le terme « Actifs » désigne la valeur totale des investissements détenus par le Compartiment pendant la période de référence.

Les investissements incluront les liquidités et quasi-liquidités selon l'Article 53 des normes techniques de réglementation en vertu du Règlement délégué (UE) 2022/1288. Cependant, les Principes comptables généralement reconnus au Luxembourg exigent que les liquidités et équivalents de liquidités soient traitées séparément. Par conséquent, le rapport annuel global contiendra une présentation différente. La trésorerie et les équivalents de trésorerie sont présentés sur la base de la date de règlement.

Investissements durables : BlackRock définit les Investissements durables comme des investissements dans des émetteurs ou des titres qui contribuent à atteindre un objectif environnemental ou social, qui ne nuisent pas de manière significative à l'un de ces objectifs et dont les sociétés bénéficiaires des investissements suivent de bonnes pratiques de gouvernance. BlackRock se réfère à des cadres de durabilité pertinents pour identifier l'alignement des investissements sur des objectifs environnementaux ou sociaux.

Ne pas nuire de manière significative (« DNSH ») : l'évaluation entreprise par BlackRock pour déterminer si un investissement ne nuit pas de manière significative à un objectif environnemental ou social en vertu du SFDR. BlackRock a développé un ensemble de critères pour tous les Investissements durables afin d'évaluer si un investissement nuit de manière significative à un objectif, en tenant compte de données de tiers et de perspectives fondamentales. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux qui sont considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Facteurs de durabilité : questions environnementales, sociales et de personnel, respect des droits de l'homme, lutte anti-corruption et actes de corruption.

Clause de non-responsabilité

Certaines informations présentées ci-dessous (les « Informations ») ont été fournies à BlackRock par des prestataires de données du marché (dont certains peuvent être des Conseillers en investissements enregistrés en vertu de l'Investment Advisers Act de 1940) (chacun étant un « Fournisseur de données »), et la reproduction et la diffusion d'une partie ou de toutes ces données sans l'autorisation écrite préalable du Fournisseur de données sont interdites. Les Informations n'ont pas été soumises à la SEC américaine, ni à aucun autre organisme de réglementation, et n'ont pas reçu d'approbation de la SEC ou d'un autre organisme. Les Informations ne peuvent pas être utilisées pour créer des ouvrages dérivés ou connexes, elles ne constituent pas une offre d'achat ou de vente, la promotion ou la recommandation d'un titre, d'un instrument financier, d'un produit ou d'une stratégie de négociation, et elles ne doivent pas être prises comme une indication ou une garantie de performance future ou d'analyse, de prévision ou de prédiction. Les Informations sont fournies « en l'état » et l'utilisateur des Informations assume l'intégralité des risques liés à toute utilisation qu'il peut faire ou permettre de faire des Informations. Le Fournisseur d'informations ne fait aucune déclaration, ne donne aucune garantie expresse ou implicite (et les rejette explicitement), et n'engage pas sa responsabilité en cas d'erreurs ou d'omissions dans les Informations, ni en cas de dommages en découlant. Ce qui précède n'exclut et ne limite aucune responsabilité qui ne peut pas être exclue ou limitée selon la législation en vigueur. Les Fournisseurs d'informations sont réputés être des tiers bénéficiaires concernant les modalités de ce paragraphe et peuvent faire appliquer ces modalités contre toute partie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Asian Sustainable Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493001IS0X9SBX98411

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 52,75 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI AC Asia ex Japan Index (l'« Indice ») après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice

Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détections du Fonds) par rapport à l'Indice MSCI AC Asia ex Japan Index

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Exclusion d'émetteurs impliqués dans : la production et la vente au détail de produits alcoolisés ; la propriété ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard ; les activités d'exploitation minière, de production et d'approvisionnement liées à l'énergie nucléaire ; la production de supports de divertissement pour adultes ; la production non conventionnelle de pétrole et de gaz ; la production d'armes conventionnelles

Exclusion des émetteurs qui ne présentent pas une notation de B ou plus, comme défini par les notations ESG Intangible Value Assessment Ratings de MSCI ou un autre fournisseur de données ESG équivalent

Le Fonds n'investira pas dans les sociétés aux émissions de carbone les plus élevées, en termes d'intensité des émissions

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI AC Asia ex Japan Index après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : A (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	52,75 %
Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'Indice MSCI AC Asia ex Japan Index	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-63,53 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 52,75 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				Réduction de l'intensité des émissions de carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Technologie de l'information	5,35 %	Taiwan (République de Chine)
Alibaba Group Holding ADR Represent	Produits accessoires	4,89 %	Chine
Samsung Electronics Non Voting Pre	Technologie de l'information	4,25 %	Corée (du Sud), République de
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	3,90 %	Irlande
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Technologie de l'information	3,65 %	Taiwan (République de Chine)
Icici Bank ADR Rep Ltd	Finance	2,78 %	Inde
Samsung Electronics Gds Represent	Technologie de l'information	2,69 %	Corée (du Sud), République de
Tencent Holdings Ltd	Communication	2,58 %	Chine
Meituan	Produits accessoires	2,36 %	Chine
Mahindra And Mahindra Reg S Gdr Lt	Produits accessoires	2,07 %	Inde
Infosys ADR Representing One Ltd	Technologie de l'information	2,01 %	Inde
Accton Technology Corp	Technologie de l'information	1,97 %	Taiwan (République de Chine)
China Mengniu Dairy Ltd	Produits de consommation courante	1,95 %	Hong Kong
Wuxi Biologics Cayman Inc	Soins de santé	1,94 %	Chine
China Merchants Bank Ltd H	Finance	1,92 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

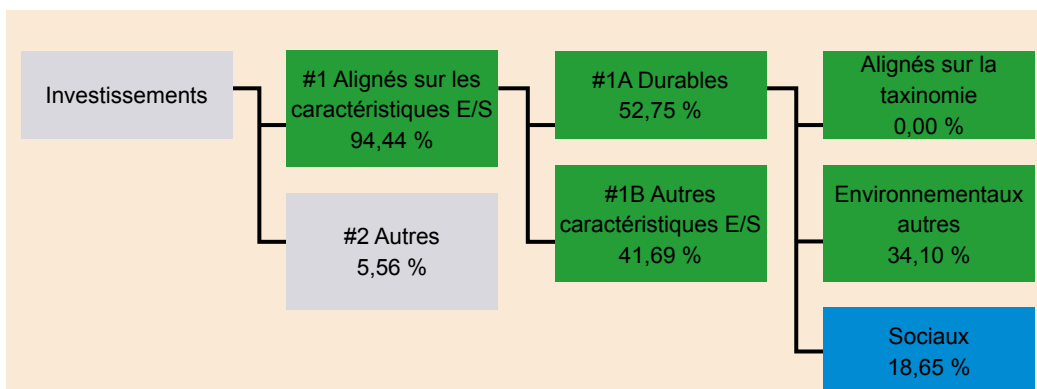
Asian Sustainable Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Finance	Banques	15,53 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	12,98 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	12,32 %
Communication	Médias et divertissement	7,71 %
Produits industriels	Biens d'équipement	5,78 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	5,48 %
Communication	Télécommunications	4,73 %
Finance	Services financiers	4,26 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	3,75 %
Matières premières	Matières premières	3,49 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	2,66 %
Finance	Assurance	2,51 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	2,36 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	2,36 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	2,33 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,18 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	1,94 %
Produits accessoires	Bien durables	1,76 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	1,65 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	1,35 %
Produits industriels	Transports	1,21 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz et charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

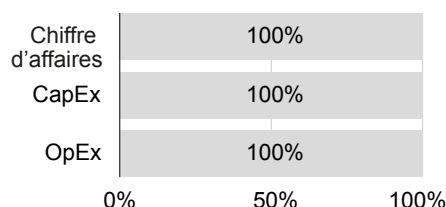
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

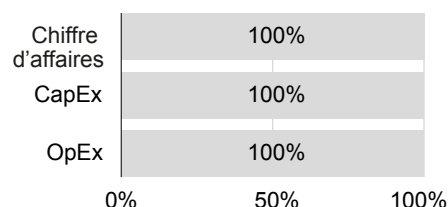
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 34,10 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 18,65 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Asian Sustainable Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown To Green Materials Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Brown to Green Materials Fund

Identifiant d'entité juridique :
529900LYRM65RB7W2C49

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 50,90 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de l'alignement d'au moins 80 % des investissements détenus par le Fonds sur le thème des matériaux de transition Exclusion des émetteurs qui n'ont pas respecté les 10 principes du Pacte mondial des Nations unies, qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de marchés développés et plus de 75 % des émetteurs de marchés émergents dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown to Green Materials Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Maintien d'au moins 80 % des investissements détenus par le Fonds en alignement sur le thème des matériaux de transition	% d'investissement dans le thème des matériaux de transition	97,00 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	50,90 %
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de marchés développés et plus de 75 % des émetteurs de marchés émergents dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % d'émetteurs de marchés développés, Plus de 75 % d'émetteurs de marchés émergents

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 50,90 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown to Green Materials Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown to Green Materials Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité	
	Maintien d'au moins 80 % des investissements détenus par le Fonds en alignement sur le thème des matériaux de transition	Exclusion des émetteurs qui n'ont pas respecté les 10 principes du Pacte mondial des Nations unies, qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption
Émissions de gaz à effet de serre (GES)	P	
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales		P

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown to Green Materials Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 6 juin 2023 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Air Liquide Société Anonyme	Matières premières	3,88 %	France
Cameco Corp	Énergie	3,87 %	Canada
Caterpillar Inc	Produits industriels	3,47 %	États-Unis
Epiroc Class A	Produits industriels	3,28 %	Suède
Crh Plc	Matières premières	3,21 %	Irlande
Linde plc	Matières premières	3,16 %	Royaume-Uni
Albemarle Corp	Matières premières	3,12 %	États-Unis
Sika Ag	Matières premières	2,97 %	Suisse
Holcim Ltd Ag	Matières premières	2,86 %	Suisse
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	2,83 %	Irlande
Nucor Corp	Matières premières	2,80 %	États-Unis
BHP Group Ltd	Matières premières	2,74 %	Australie
LG Chem Ltd	Matières premières	2,74 %	Corée (du Sud), République de
Mineral Resources Ltd	Matières premières	2,73 %	Australie
Aurubis AG	Matières premières	2,71 %	Allemagne

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

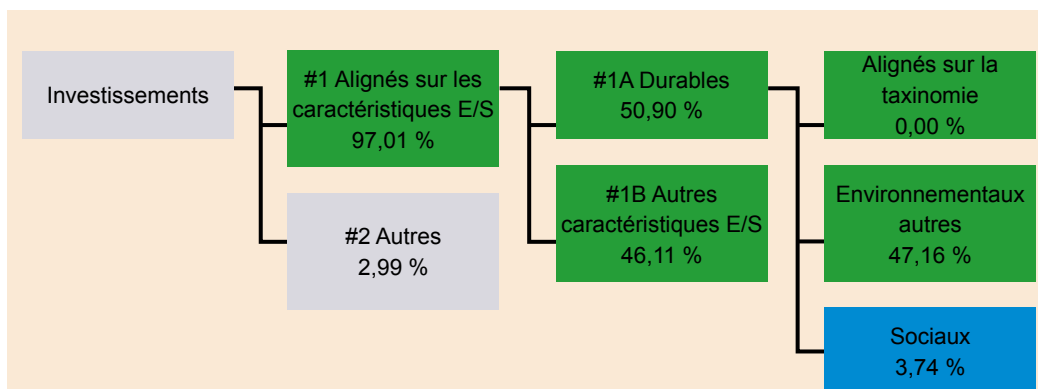
Brown to Green Materials Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown to Green Materials Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Matières premières	Matières premières	76,97 %
Produits industriels	Biens d'équipement	15,03 %
Énergie	Charbon et combustibles	3,87 %
Finance	Services financiers	2,83 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	1,13 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown to Green Materials Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

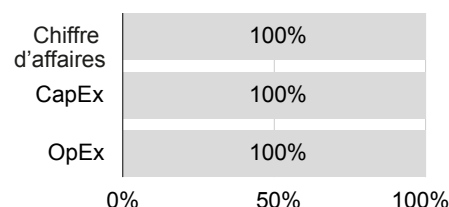
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

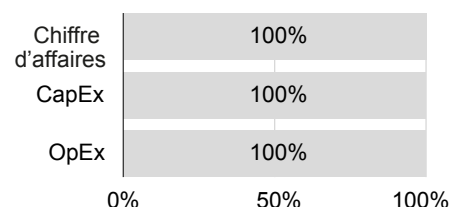
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown to Green Materials Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 47,16 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 3,74 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Brown to Green Materials Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
China Flexible Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300SP5VA78OYD5C95

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

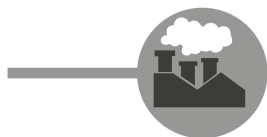
Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Tencent Holdings Ltd	Communication	8,55 %	Chine
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Finance	6,40 %	Irlande
Kweichow Moutai Ltd A	Produits de consommation courante	5,21 %	Chine
Alibaba Group Holding Adr Represen	Produits accessoires	3,61 %	Chine
Meituan	Produits accessoires	3,06 %	Chine
Alibaba Group Holding Ltd	Produits accessoires	2,90 %	Chine
Nari Technology Ltd A	Produits industriels	2,52 %	Chine
Hangzhou Oxygen Plant Group Ltd A	Matières premières	2,51 %	Chine
Aia Group Ltd	Finance	2,43 %	Hong Kong
China Yangtze Power Ltd A	Services aux collectivités	2,39 %	Chine
Bank of Ningbo Ltd A	Finance	2,39 %	Chine
China Merchants Bank Ltd H	Finance	2,38 %	Chine
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	Soins de santé	2,30 %	Chine
Anhui Honglu Steel Construction	Matières premières	2,28 %	Chine
Beijing Tongrentang Ltd A	Soins de santé	2,22 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

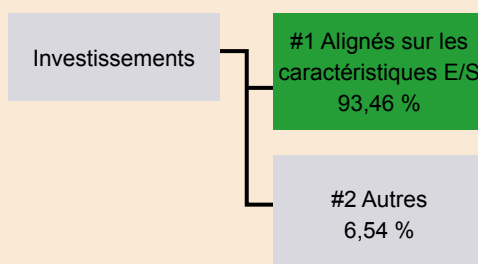
China Flexible Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Communication	Médias et divertissement	13,15 %
Produits industriels	Biens d'équipement	12,25 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	8,87 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	8,62 %
Matières premières	Matières premières	7,83 %
Finance	Services financiers	7,29 %
Finance	Banques	6,16 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	5,43 %
Finance	Assurance	4,62 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	3,63 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	3,51 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	3,51 %
Produits accessoires	Bien durables	3,35 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	2,82 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	2,30 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	2,26 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	1,88 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	1,36 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	1,01 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

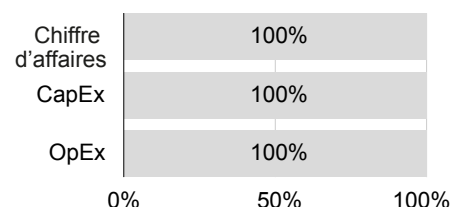
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

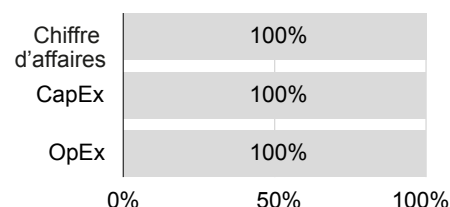
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Flexible Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
China Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300835EE70C7CKG16

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Tencent Holdings Ltd	Communication	8,68 %	Chine
Alibaba Group Holding Ltd	Produits accessoires	7,64 %	Chine
Meituan	Produits accessoires	4,06 %	Chine
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Finance	3,92 %	Irlande
NetEase Inc	Communication	3,32 %	Chine
Trip.com Group Adr Ltd	Produits accessoires	2,82 %	Chine
Ping An Insurance (Group) Co of China	Finance	2,82 %	Chine
China Merchants Bank Ltd H	Finance	2,53 %	Chine
Yum China Holdings Inc	Produits accessoires	2,50 %	Chine
China Construction Bank Corp H	Finance	2,32 %	Chine
Pdd Holdings Ads Inc	Produits accessoires	2,22 %	Chine
Contemporary Amperex Technology Ltd	Produits industriels	2,17 %	Chine
China Mengniu Dairy Ltd	Produits de consommation courante	2,12 %	Hong Kong
China Resources Beer Holdings Ltd	Produits de consommation courante	2,09 %	Hong Kong
BYD Ltd H	Produits accessoires	1,90 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

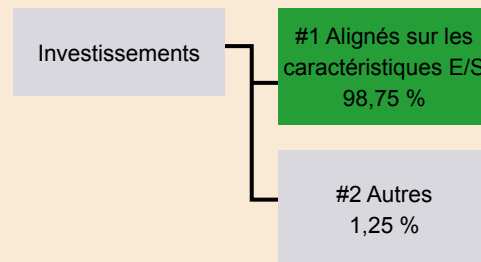
China Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Communication	Médias et divertissement	15,81 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	12,61 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	12,51 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	7,86 %
Produits industriels	Biens d'équipement	7,65 %
Finance	Banques	6,81 %
Finance	Services financiers	5,44 %
Matières premières	Matières premières	4,98 %
Finance	Assurance	4,55 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	2,95 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	2,75 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	2,71 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	2,38 %
Produits accessoires	Bien durables	2,24 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	1,90 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	1,71 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	1,42 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	1,41 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	1,31 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	1,30 %
Produits industriels	Transports	1,20 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	1,16 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

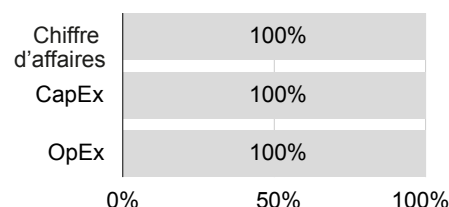
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

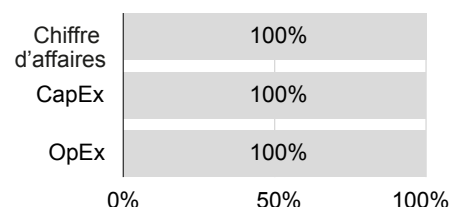
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

China Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
China Impact Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493007HPC5SZWZ17R10

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 48,26 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 43,01 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)



Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'investissement durable.

Objectifs d'investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'Indice MSCI China All Share 10/40 (l'« Indice »)

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'univers d'investissement du Fonds après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de cet univers d'investissement. L'univers d'investissement utilisé pour l'évaluer est un regroupement des Indices MSCI China 10/40 et MSCI China A Share. Il a été choisi car il représente le plus fidèlement l'étendue de l'univers d'investissement du Fonds sur les marchés boursiers chinois onshore et offshore.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Exclusion des émetteurs impliqués dans la production et la vente au détail de produits alcoolisés, la possession ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard, la production de divertissement pour adultes, la production d'armes conventionnelles ; des sociétés avec des réserves de pétrole, de schiste bitumineux, de sables bitumineux, de charbon, de charbon thermique ou de sables pétrolifères ; et des sociétés productrices d'électricité à partir de charbon thermique

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'univers d'investissement du Fonds après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de cet univers d'investissement. L'univers d'investissement utilisé pour l'évaluer est un regroupement des Indices MSCI China 10/40 et MSCI China A Share. Il a été choisi car il représente le plus fidèlement l'étendue de l'univers d'investissement du Fonds sur les marchés boursiers chinois onshore et offshore.	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : BBB (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'Indice MSCI China All Share 10/40 (l'« Indice »)	Intensité des émissions carbone par rapport à l'indice de référence	-54,20 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	91,27 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexactes ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Emissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)

Empreinte carbone

Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements

Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles

Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable

Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique

Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité

Rejets dans l'eau

Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs

Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales

Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales

Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé

Mixité au sein des organes de gouvernance

Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, munitions à fragmentation, armes chimiques et biologiques)

Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)

Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
China Water Affairs Group Ltd	Services aux collectivités	5,63 %	Hong Kong
BLK ICS USD Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	5,44 %	Irlande
Contemporary Ampere Technology Ltd	Produits industriels	4,21 %	Chine
Sungrow Power Supply Ltd A	Produits industriels	4,18 %	Chine
Hygeia Healthcare Holdings Ltd	Soins de santé	4,11 %	Chine
Anhui Honglu Steel Construction (G	Matières premières	3,68 %	Chine
Ke Holdings Adr Representing Inc	Immobilier	3,65 %	Chine
Nari Technology Ltd A	Produits industriels	3,62 %	Chine
Kanzhun American Depository Shares	Communication	3,59 %	Chine
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	Soins de santé	3,50 %	Chine
Ganfeng Lithium Group Ltd A	Matières premières	3,38 %	Chine
Zhejiang Weixing New Building Materials	Produits industriels	3,32 %	Chine
Aier Eye Hospital Group Ltd A	Soins de santé	3,23 %	Chine
Hongfa Technology Ltd A	Produits industriels	2,83 %	Chine
Glodon Ltd A	Technologie de l'information	2,62 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

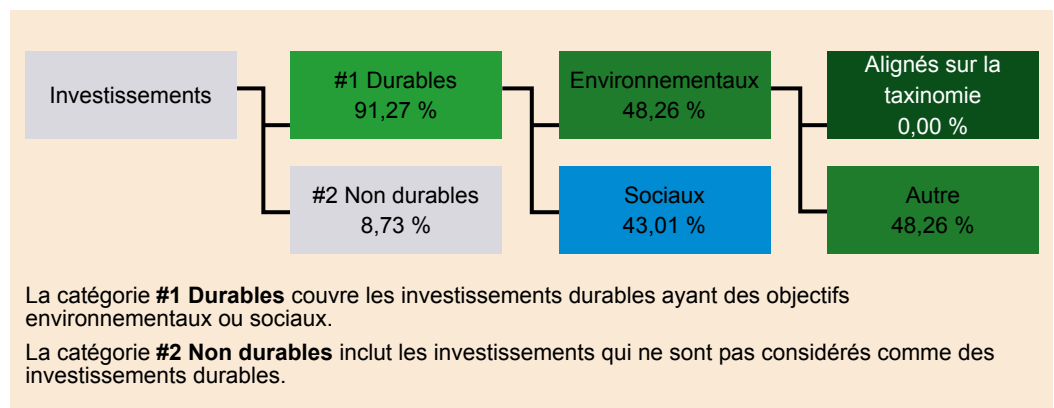
China Impact Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	27,60 %
Matières premières	Matières premières	12,25 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	10,84 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	10,35 %
Finance	Services financiers	6,10 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	5,73 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	5,29 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	5,17 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	4,23 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	3,65 %
Communication	Médias et divertissement	3,59 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	1,60 %
Produits accessoires	Bien durables	1,51 %
Finance	Banques	1,49 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

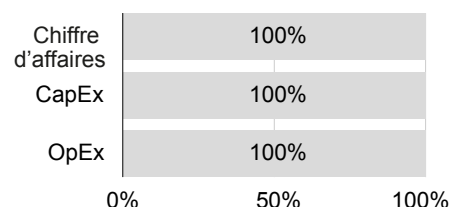
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

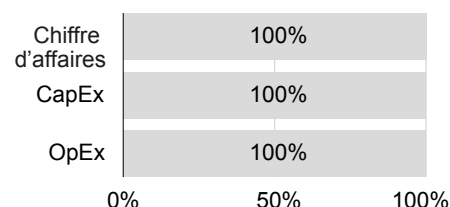
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 48,26 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 43,01 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détections n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Impact Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
China Innovation Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300LRPLM6J4CVQV44

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI China All Shares Index (l'« Indice »)

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de marchés développés et plus de 75 % des émetteurs de marchés émergents dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à l'indice MSCI China All Shares Index	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-80,79 %
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de marchés développés et plus de 75 % des émetteurs de marchés émergents dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % d'émetteurs de marchés développés, Plus de 75 % d'émetteurs de marchés émergents
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P	
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Tencent Holdings Ltd	Communication	3,61 %	Chine
Glodon Ltd A	Technologie de l'information	3,00 %	Chine
Trip.com Group Ltd	Produits accessoires	2,75 %	Chine
Pdd Holdings Ads Inc	Produits accessoires	2,40 %	Chine
Accton Technology Corp	Technologie de l'information	2,39 %	Taiïwan (République de Chine)
Beijing Kingsoft Office Software I	Technologie de l'information	2,21 %	Chine
Jsc Kaspi Kz Global Sponsored Reg	Finance	2,20 %	Kazakhstan
Contemporary AmpereX Technology Ltd	Produits industriels	2,20 %	Chine
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Technologie de l'information	2,11 %	Taiïwan (République de Chine)
Alibaba Group Holding Ltd	Produits accessoires	2,06 %	Chine
Alchip Technologies Ltd	Technologie de l'information	2,01 %	Taiïwan (République de Chine)
Sony Group Adr Representing Corp	Produits accessoires	2,01 %	Japon
Nari Technology Ltd A	Produits industriels	1,87 %	Chine
NetEase Inc	Communication	1,80 %	Chine
BYD Ltd H	Produits accessoires	1,72 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

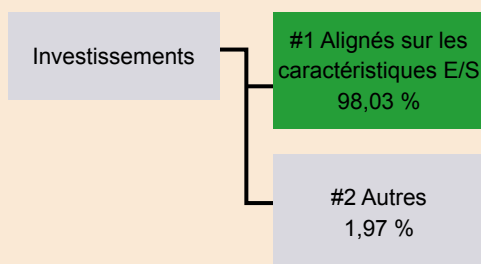
China Innovation Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	18,21 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	17,90 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	15,16 %
Produits industriels	Biens d'équipement	11,79 %
Communication	Médias et divertissement	9,28 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	5,64 %
Finance	Services financiers	5,03 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	4,80 %
Produits accessoires	Bien durables	3,90 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	3,52 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	1,38 %
Matières premières	Matières premières	1,36 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

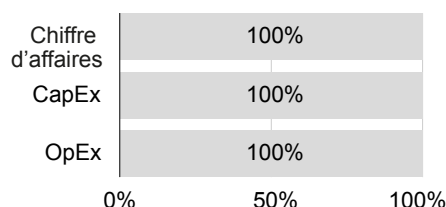
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

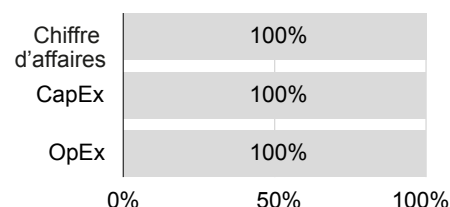
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental** au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Innovation Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
China Multi-Asset Fund

Identifiant d'entité juridique :
529900OA8MFVQWXPHV58

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif et n'adoptent pas uniquement des filtres d'exclusion ESG en tant que politique ESG ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG dont le statut est conforme au Règlement SFDR, en particulier aux exigences énoncées à l'Article 8 et 9 du Règlement SFDR

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents et stratégies d'investissement qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif et n'adoptent pas uniquement des filtres d'exclusion ESG en tant que politique ESG ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG dont le statut est conforme au Règlement SFDR	% de détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents et de stratégies d'investissement dans le total de l'actif	76,63 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 13 juillet 2023 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BLK ICS Us Treas Premier Acc	Fonds mutuels	18,13 %	Irlande
BGF China Onshore Bnd Fd X2 Us H	Fonds mutuels	17,82 %	Luxembourg
Lyxor MSCI China Esg Ldrs Extra Dr	ETF	8,93 %	Luxembourg
BGF Systematic China Environ X2Us	Fonds mutuels	7,72 %	Luxembourg
BGF China Impact Fund X2 Usd	Fonds mutuels	7,66 %	Luxembourg
Tencent Holdings Ltd	Communication	3,66 %	Chine
Alibaba Group Holding Ltd	Produits accessoires	2,02 %	Chine
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	Soins de santé	1,12 %	Chine
Geely Automobile Holdings Ltd	Produits accessoires	0,99 %	Hong Kong
Inner Mongolia Yili Industrial Gro	Produits de consommation courante	0,98 %	Chine
Zte Corp A	Technologie de l'information	0,96 %	Chine
Ping An Insurance (Group) Co of China	Finance	0,89 %	Chine
Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	Produits accessoires	0,88 %	Chine
China Vanke Ltd H	Immobilier	0,87 %	Chine
Sichuan Kelun Pharmaceutical Ltd A	Soins de santé	0,84 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

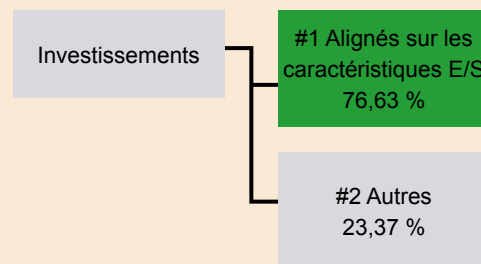
China Multi-Asset Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	11,69 %
Communication	Médias et divertissement	6,00 %
Finance	Banques	5,73 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	5,61 %
Titres gouvernementaux	Titres gouvernementaux	5,58 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	4,31 %
Finance	Services financiers	3,31 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	2,40 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	2,40 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	2,27 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	2,16 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	2,02 %
Produits accessoires	Bien durables	2,00 %
Finance	Assurance	1,81 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	1,38 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	1,32 %
Matières premières	Matières premières	1,09 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,58 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	0,33 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	0,03 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,00 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	0,00 %
Énergie	Charbon et combustibles	0,00 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (tels que définis par le Global Industry Classification System) : raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

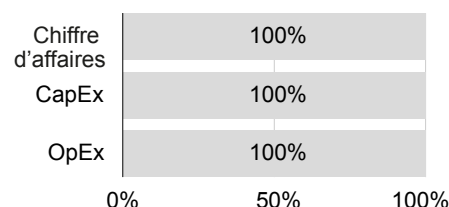
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

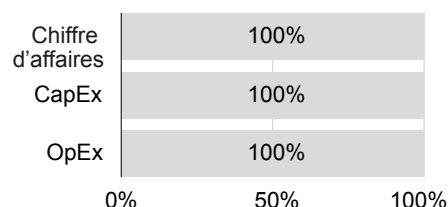
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Multi-Asset Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
China Onshore Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300Q3DMBDT56WEZ03

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 24,86 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	18,96 %
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %	Réduction de l'univers d'investissement	La politique ESG a réduit l'univers d'investissement de plus de 20 % sur la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	24,86 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 24,86 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- (iv) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité		
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E		

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 6 septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
China Development Bank 2024-12-14	Gouvernemental	6,73 %	Chine
Bank Of China Ltd Regs 2032-01-24	Gouvernemental	2,37 %	Chine
China Construction Bank Corp Regs 2032-06-17	Gouvernemental	2,01 %	Chine
Chongqing Rail Transit Group Co Lt Mtn 2024-09-20	Biens de consommation cyclique	1,63 %	Chine
Chengdu Rail Transit Group Co Ltd Mtn 2079-12-31	Biens de consommation cyclique	1,63 %	Chine
Zhengzhou Urban Construction Inves 2024-03-30	Gouvernemental	1,62 %	Chine
Tianjin Rail Transit Group Co Ltd Mtn 2023-09-16	SCPI	1,62 %	Chine
China Three Gorges Corp Mtn 2023-12-03	Gouvernemental	1,62 %	Chine
Hubei Communications Investment Gr Mtn 2024-03-22	Électricité	1,61 %	Chine
Qingdao Metro Group Co Ltd Mtn 2026-06-17	Autres industries	1,61 %	Chine
Zhuhai Huafa Group Co Ltd Mtn 2024-01-16	Gouvernemental	1,60 %	Chine
Sichuan Expressway Construction & Mtn 2024-02-26	Biens de consommation cyclique	1,60 %	Chine
Guangzhou Communication Investment Mtn 2024-07-12	Transports	1,60 %	Chine
China Railway Group Ltd Mtn 2024-05-28	Autres industries	1,60 %	Chine
Bank Of Communications Co Ltd Regs 2032-02-25	Banques	1,59 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

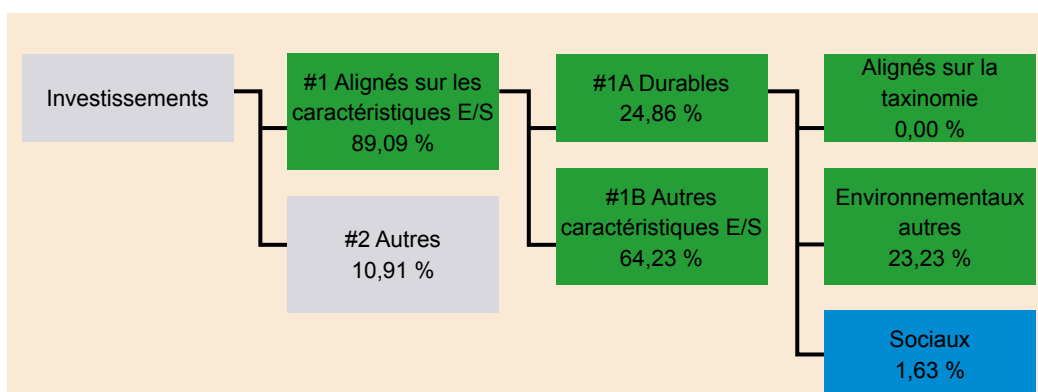
China Onshore Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Gouvernemental	Agence	20,25 %
Banques	Autre	13,37 %
Gouvernemental	Autorités locales	9,43 %
Autres industries	Autre	7,10 %
Transports	Services de transport	5,56 %
Biens de consommation cyclique	Construction individuelle	5,30 %
Trésor	Trésor	4,88 %
Autres secteurs financiers	Autre	3,34 %
Électricité	Autre	2,42 %
Courtage	Autre	2,17 %
/Gestionnaires d'actifs/Change		
Sociétés de financement	Autre	2,06 %
SCPI	Autres REIT	1,82 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	1,61 %
Biens de consommation cyclique	Services de consommation cyclique	1,60 %
Technologie	Autre	1,58 %
Gaz naturel	Autre	1,08 %
Énergie	Midstream	0,27 %
Énergie	Indépendante	0,00 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : intégrés, services du secteur pétrolier, raffinage.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

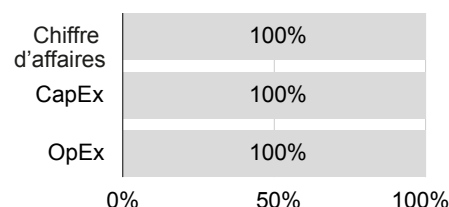
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

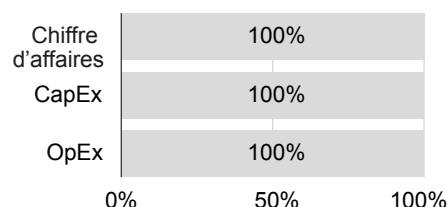
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 23,23 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 1,63 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

China Onshore Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dénomination du produit :
Circular Economy Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300DE2JONQNR76N75

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

X **Oui**

Non

X Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 85,55 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

X dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

X Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 8,61 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'Investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'Investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI All Countries World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI All Countries World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	94,16 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

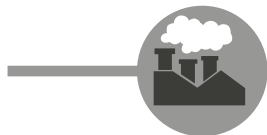
- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexactes ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Emissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)
Empreinte carbone
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
Rejets dans l'eau
Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales
Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales
Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
Mixité au sein des organes de gouvernance
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, munitions à fragmentation, armes chimiques et biologiques)
Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BLK ICS USD Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	3,99 %	Irlande
Republic Services Inc	Produits industriels	3,80 %	États-Unis
Microsoft Corp	Technologie de l'information	3,65 %	États-Unis
Coca Cola Europacific Partners Plc	Produits de consommation courante	3,54 %	Royaume-Uni
Waste Management Inc	Produits industriels	3,13 %	États-Unis
Veolia Environ. Sa	Services aux collectivités	3,00 %	France
Tjx Inc	Produits accessoires	2,99 %	États-Unis
Nestlé SA	Produits de consommation courante	2,84 %	Suisse
Xylem Inc	Produits industriels	2,80 %	États-Unis
Agilent Technologies Inc	Soins de santé	2,77 %	États-Unis
Sig Group N Ag	Matières premières	2,77 %	Suisse
Ecolab Inc	Matières premières	2,73 %	États-Unis
Lkq Corp	Produits accessoires	2,72 %	États-Unis
Schneider Electric	Produits industriels	2,69 %	France
Keyence Corp	Technologie de l'information	2,62 %	Japon

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

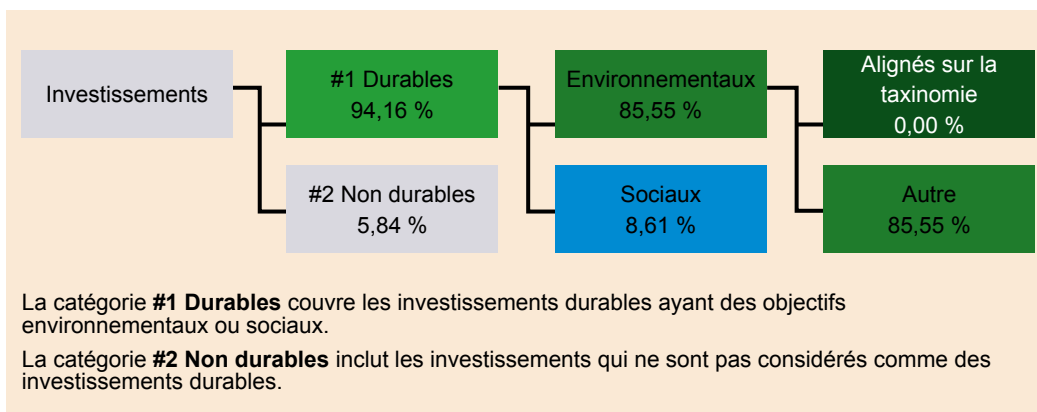
Circular Economy Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Matières premières	Matières premières	25,34 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	15,65 %
Produits industriels	Biens d'équipement	14,28 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	6,70 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	5,95 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	5,71 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	5,36 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	4,07 %
Finance	Services financiers	3,99 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	3,80 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	3,00 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	2,48 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	2,07 %
Produits accessoires	Bien durables	1,12 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

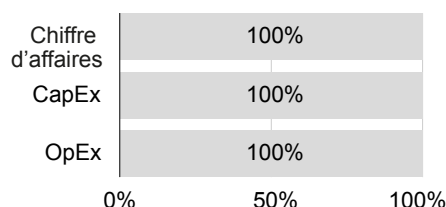
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

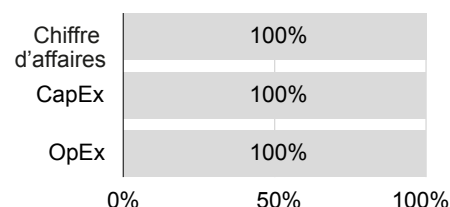
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 85,55 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 8,61 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Circular Economy Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dénomination du produit :
Climate Action Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300CC6UVDVS2UA106

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 73,88 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 18,37 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'Investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'Investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI All Countries World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice Exclusion de l'investissement dans des sociétés qui sont classées dans les secteurs suivants (tels que définis selon la classification Global Industry Classification Standard) : charbon et consommables, exploration/production pétrolière et gazière, pétrole et gaz intégrés, tabac

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI All Countries World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Exclusion de l'investissement dans des sociétés qui sont classées dans les secteurs suivants (tels que définis selon la classification Global Industry Classification Standard) : charbon et consommables, exploration/production pétrolière et gazière, pétrole et gaz intégrés, tabac	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	92,25 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexactes ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Emissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)

Empreinte carbone

Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements

Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles

Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable

Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique

Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité

Rejets dans l'eau

Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs

Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales

Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales

Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé

Mixité au sein des organes de gouvernance

Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, munitions à fragmentation, armes chimiques et biologiques)

Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)

Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BLK ICS USD Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	5,50 %	Irlande
NextEra Energy Inc	Services aux collectivités	3,88 %	États-Unis
EDP Renováveis Sa	Services aux collectivités	3,84 %	Espagne
Deere	Produits industriels	3,76 %	États-Unis
Enel	Services aux collectivités	3,16 %	Italie
Ag Growth International Inc	Produits industriels	3,01 %	Canada
Bunge Ltd	Produits de consommation courante	2,64 %	États-Unis
Kerry Group Plc	Produits de consommation courante	2,52 %	Irlande
Waste Management Inc	Produits industriels	2,48 %	États-Unis
FMC Corp	Matières premières	2,38 %	États-Unis
Ecolab Inc	Matières premières	2,33 %	États-Unis
Nutrien Ltd	Matières premières	2,27 %	Canada
Sig Group N Ag	Matières premières	2,13 %	Suisse
Republic Services Inc	Produits industriels	2,12 %	États-Unis
Symrise AG	Matières premières	2,10 %	Allemagne

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

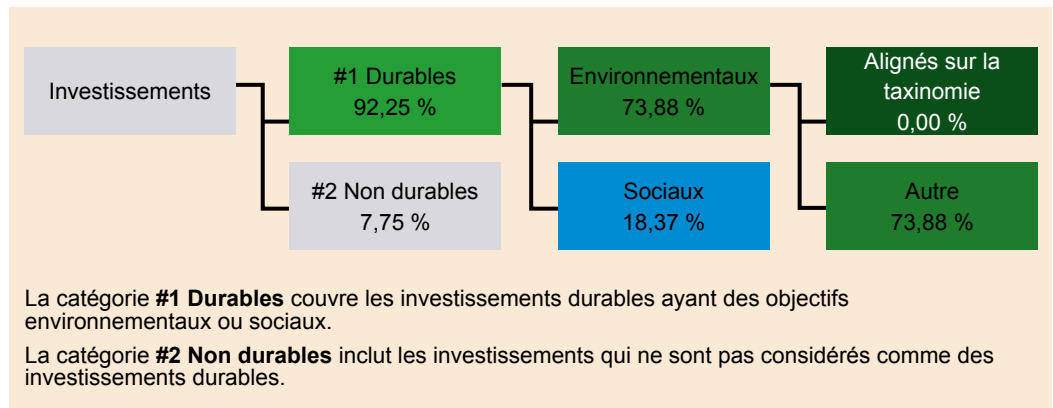
Climate Action Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	24,54 %
Matières premières	Matières premières	23,24 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	13,82 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	11,69 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	8,61 %
Finance	Services financiers	6,58 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	5,32 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	3,41 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	2,21 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

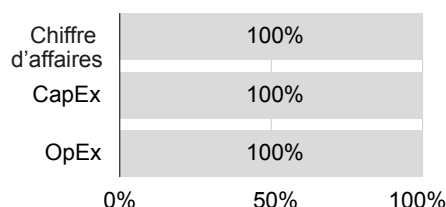
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

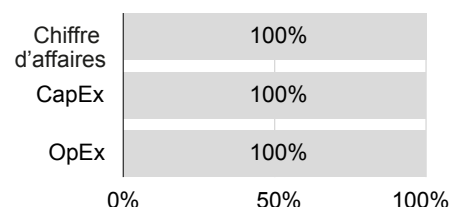
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 73,88 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 18,37 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
Climate Action Multi-Asset Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300WXHUWHCE8DHR77

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 69,84 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 15,13 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)



Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'investissement durable.

Objectifs d'investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG des Indices MSCI All Country World Index 65 % et Bloomberg Global Aggregate Bond Index (Hedged to EUR) 35 % après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses des Indices

Réduction de l'intensité des émissions carbone (d'après la valeur d'entreprise trésorerie comprise ou « EVIC ») par rapport aux indices de référence MSCI All Country World Index 65 % et Bloomberg Global Aggregate Bond Index (Hedged to EUR) 35 %

Réduction de l'intensité des émissions carbone d'année en année

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG des Indices MSCI All Country World Index 65 % et Bloomberg Global Aggregate Bond Index (Hedged to EUR) 35 % après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses des Indices	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Réduction de l'intensité des émissions carbone (d'après l'« EVIC ») par rapport aux indices de référence MSCI All Country World Index 65 % et Bloomberg Global Aggregate Bond Index (Hedged to EUR) 35 %	Intensité des émissions carbone par rapport à l'indice de référence	-35,54 %
Réduction de l'intensité des émissions carbone d'année en année d'après l'EVIC	% de réduction de l'intensité des émissions carbone du portefeuille au 31 août 2023 par rapport au 31 août 2022	-14,65 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	84,97 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexactes ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Emissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)
Empreinte carbone
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
Rejets dans l'eau
Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales
Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales
Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
Mixité au sein des organes de gouvernance
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, munitions à fragmentation, armes chimiques et biologiques)
Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Aquila European Renewables Plc	Finance	3,13 %	Royaume-Uni
Greencoat Renewables Plc	Services aux collectivités	2,96 %	Irlande
Greencoat UK Wind Plc	Services aux collectivités	2,84 %	Royaume-Uni
SDCL Energy Efficiency Income Trust	Finance	2,77 %	Royaume-Uni
Microsoft Corp	Technologie de l'information	2,05 %	États-Unis
iShares Physical Gold	Finance	1,97 %	Irlande
Gresham House Energy Storage Fund	Finance	1,70 %	Royaume-Uni
Apple Inc	Technologie de l'information	1,66 %	États-Unis
iShares Eur Govt Bond Climate Ucits	Finance	1,60 %	Irlande
Foresight Solar Fund Ltd	Finance	1,55 %	Jersey, Iles anglo-normandes
Deere	Produits industriels	1,36 %	États-Unis
iShares Global Govt Bond Eur Hd D	Finance	1,25 %	Irlande
iShares Green Bd Idx (le) D Eur Hdg	Fonds communs de placement	1,12 %	Irlande
CDP Financial Inc Mtn 144A	Finance	0,96 %	Canada
European Investment Bank	Finance	0,85 %	Supranational

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

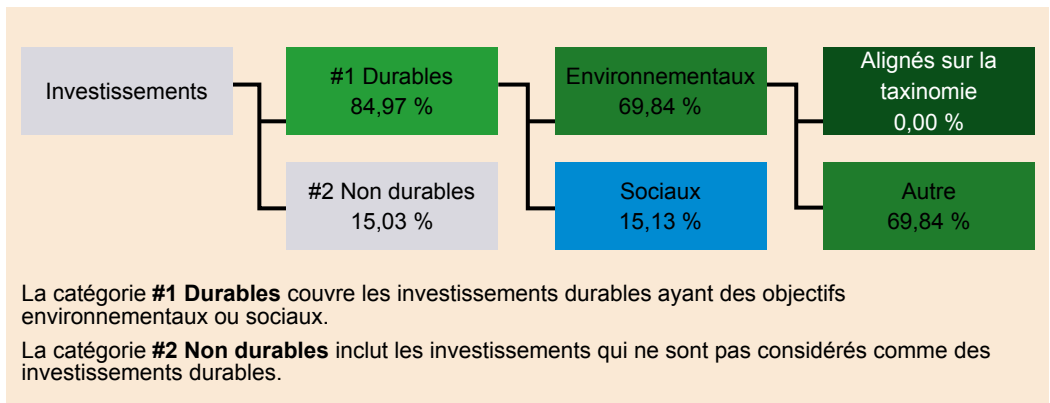
Climate Action Multi-Asset Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Finance	Services financiers	18,85 %
Produits industriels	Biens d'équipement	10,90 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	9,40 %
Matières premières	Matières premières	7,39 %
Finance	Banques	7,29 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	5,54 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	5,09 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	4,82 %
Titres gouvernementaux	Titres gouvernementaux	4,70 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	3,76 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	3,40 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	2,42 %
Autre	Autre	1,98 %
Communication	Télécommunications	1,45 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	1,42 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,15 %
Énergie	Charbon et combustibles	0,11 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,03 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,01 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	0,01 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	0,00 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	0,00 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

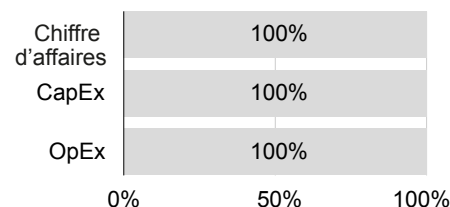
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

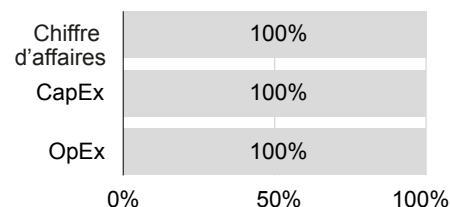
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 69,84 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 15,13 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités et des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Climate Action Multi-Asset Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Continental European Flexible Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300EK4APWIQOV3Y73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 14 décembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Novo Nordisk Class B	Soins de santé	8,78 %	Danemark
LVMH	Produits accessoires	7,75 %	France
ASML Holding NV	Technologie de l'information	6,41 %	Pays-Bas
Lonza Group AG	Soins de santé	5,05 %	Suisse
STMicroelectronics NV	Technologie de l'information	3,76 %	Suisse
Dsv	Produits industriels	3,43 %	Danemark
UniCredit	Finance	3,39 %	Italie
Linde plc	Matières premières	3,08 %	Royaume-Uni
BE Semiconductor Industries NV	Technologie de l'information	3,02 %	Pays-Bas
Hermes International	Produits accessoires	2,99 %	France
ASM International NV	Technologie de l'information	2,95 %	Pays-Bas
Commerzbank AG	Finance	2,87 %	Allemagne
Société Générale SA	Finance	2,75 %	France
Bank of Ireland Group Plc	Finance	2,70 %	Irlande
Sika Ag	Matières premières	2,68 %	Suisse

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

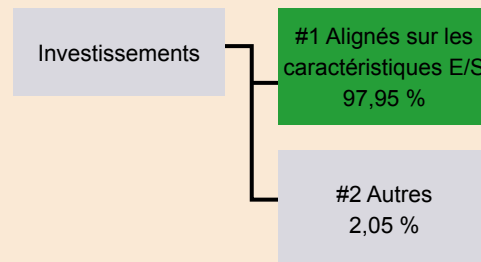
Continental European Flexible Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	16,60 %
Finance	Banques	16,18 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	16,14 %
Produits industriels	Biens d'équipement	14,20 %
Produits accessoires	Bien durables	13,09 %
Matières premières	Matières premières	7,37 %
Finance	Services financiers	5,13 %
Produits industriels	Transports	3,43 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,40 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	2,04 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	0,93 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

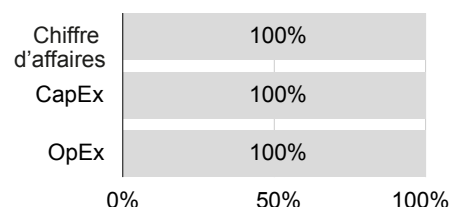
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

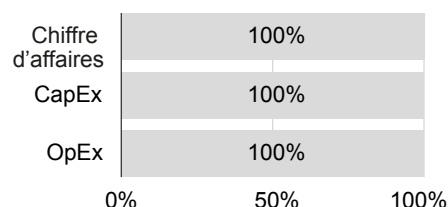
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Continental European Flexible Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Developed Markets Sustainable Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300RZN20CR9GE2N37

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 59,02 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI World Index (l'« Indice ») après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice

Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détections du Fonds) par rapport à l'indice MSCI World Index

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Exclusion des émetteurs impliqués dans la production et la vente au détail de produits alcoolisés, la possession ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard, les activités d'exploitation minière, de production et d'approvisionnement liées à l'énergie nucléaire, la production de divertissement pour adultes, la production non conventionnelle de pétrole et de gaz et la production d'armes conventionnelles

Exclusion des émetteurs qui ne présentent pas une notation de B ou plus, comme défini par les notations ESG Intangible Value Assessment Ratings de MSCI ou un autre fournisseur de données ESG équivalent

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI World Index	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-53,53 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	59,02 %
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 59,02 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Réduction de l'intensité des émissions de carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Microsoft Corp	Technologie de l'information	7,40 %	États-Unis
Mastercard Inc Class A	Finance	5,16 %	États-Unis
Nestlé SA	Produits de consommation courante	4,14 %	Suisse
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	3,88 %	États-Unis
Schneider Electric	Produits industriels	3,82 %	France
Alphabet Inc Class A	Communication	3,69 %	États-Unis
RELX Plc	Produits industriels	3,48 %	Royaume-Uni
Otis Worldwide Corp	Produits industriels	3,39 %	États-Unis
ASML Holding NV	Technologie de l'information	3,14 %	Pays-Bas
Rentokil Initial Plc	Produits industriels	3,13 %	Royaume-Uni
American Express	Finance	3,10 %	États-Unis
BNP Paribas SA	Finance	3,07 %	France
Astrazeneca Plc	Soins de santé	3,06 %	Royaume-Uni
Verisk Analytics Inc	Produits industriels	2,97 %	États-Unis
Analog Devices Inc	Technologie de l'information	2,69 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

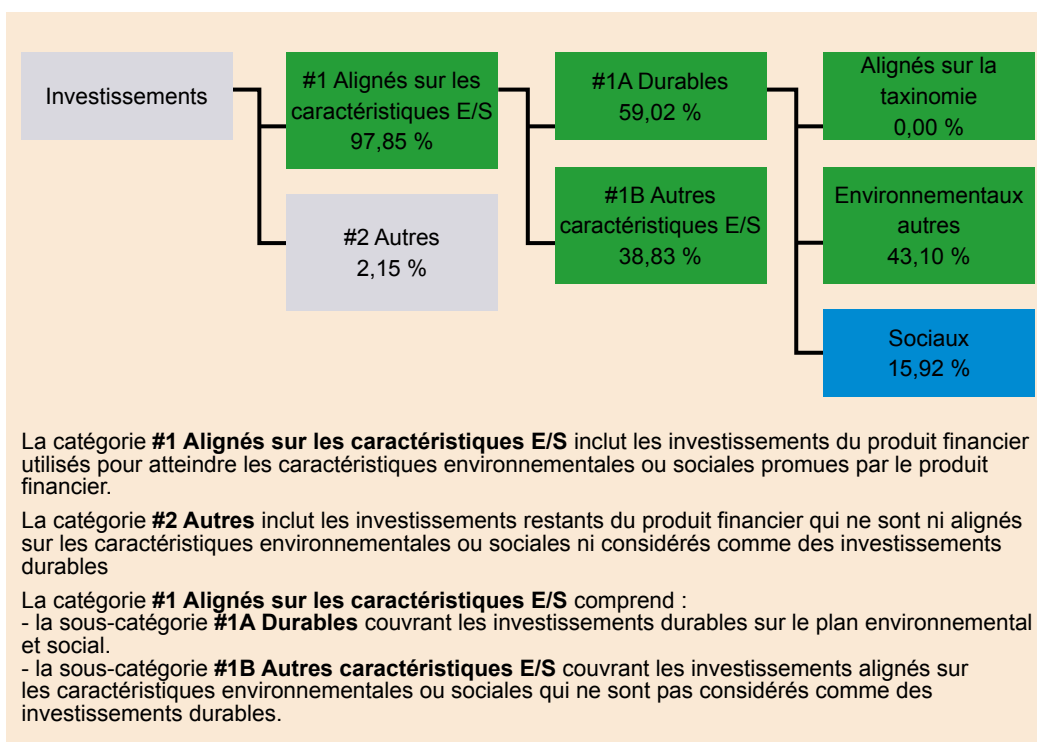
Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	13,73 %
Finance	Services financiers	11,01 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	10,74 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	9,99 %
Produits industriels	Biens d'équipement	9,08 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	7,86 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	6,40 %
Communication	Médias et divertissement	6,30 %
Finance	Banques	5,24 %
Matières premières	Matières premières	4,44 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	4,14 %
Produits accessoires	Bien durables	3,52 %
Produits industriels	Transports	2,10 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	2,04 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	1,82 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	1,36 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

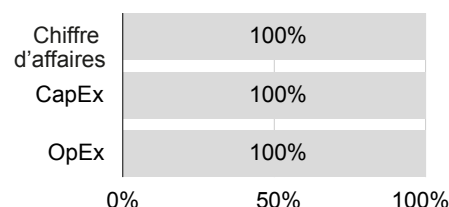
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

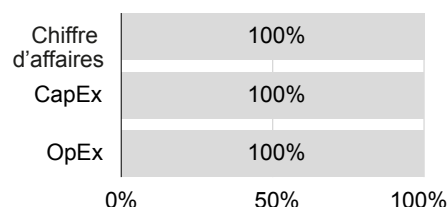
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 43,10 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 15,92 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Developed Markets Sustainable Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
Emerging Markets Corporate Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
54930082CEG4U885EN40

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 74,13 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 18,60 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Exclusion des investissements dans des titres d'émetteurs qui, selon le Gestionnaire Financier par délégation, sont exposés ou liés à des armes controversées

Exclusion des investissements dans des titres d'émetteurs qui tirent plus de cinq pour cent de leurs revenus de la production, de la distribution, de l'octroi de licences, de la vente au détail ou de la fourniture de tabac ou de produits liés au tabac

Exclusion des investissements dans des titres d'émetteurs exposés ou liés à la production ou à la distribution d'armes à feu ou de munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion de l'investissement dans des titres d'émetteurs réputés n'avoir pas respecté un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies, qui couvrent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption

Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %. Aux fins d'évaluation de cette réduction uniquement, une combinaison des indices JPMorgan Emerging Markets Bond Index et JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index est utilisée pour définir l'univers d'investissement	Réduction de l'univers d'investissement	La politique ESG a réduit l'univers d'investissement de plus de 20 % sur la période de référence
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	92,80 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	92,73 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexactes ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Emissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)
Empreinte carbone
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
Rejets dans l'eau
Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales
Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales
Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
Mixité au sein des organes de gouvernance
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, munitions à fragmentation, armes chimiques et biologiques)
Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Mexique (États-Unis mexicains) (Go 2027-09-18)	Gouvernemental	3,42 %	Mexique
Fondo Mivivienda Sa Regs 2027-04-12	Gouvernemental	3,33 %	Pérou
Chili (République du) 2027-01-31	Gouvernemental	2,98 %	Chili
Bahia Sul Holdings Gmbh Regs 2026-07-14	Industrie de base	2,97 %	Autriche
Serbie (République de) Mtn Regs 2028-09-23	Gouvernemental	2,76 %	Serbie, République de
Empresa Nacional De Telecomunicaci Regs 2032-09-14	Communications	2,65 %	Chili
Mercadolibre Inc 2026-01-14	Biens de consommation cyclique	2,64 %	États-Unis
Star Energy Geothermal Darajat Ii Regs 2038-10-14	Électricité	2,64 %	Bermudes
Colbun Sa Regs 2032-01-19	Électricité	2,56 %	Chili
Banco Bradesco Sa (Îles Caïmans Regs 2027-03-18)	Banques	2,56 %	Îles Caïmans
Posco Regs 2024-07-15	Industrie de base	2,52 %	Corée (du Sud), République de
Banco Continental Saeca Regs 2025-12-10	Banques	2,45 %	Paraguay
Gaci First Investment Co Mtn Regs 2027-10-13	Gouvernemental	2,38 %	Îles Caïmans
Industrial And Commercial Bank Of Mtn Regs 2026-10-28	Gouvernemental	2,33 %	Hong Kong
Baidu Inc 2031-08-23	de l'information	2,14 %	Îles Caïmans

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

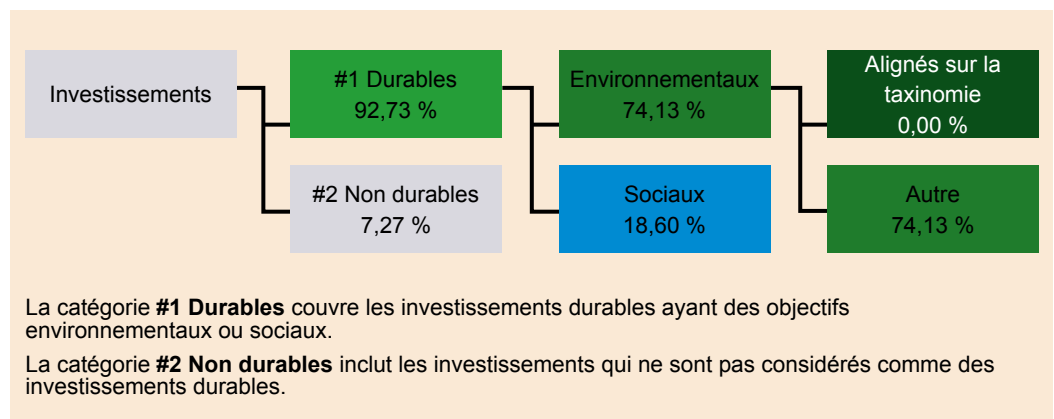
Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Gouvernemental	Agence	27,19 %
Gouvernemental	Souverain	16,55 %
Électricité	Autre	9,89 %
Industrie de base	Papier	9,02 %
Banques	Autre	6,62 %
Technologie	Autre	5,57 %
Autres secteurs financiers	Autre	3,77 %
Biens de consommation cyclique	Détaillants	3,02 %
Communications	Wireless	2,65 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	2,52 %
Gouvernemental	Supranational	2,45 %
Biens d'équipement	Manufacture diversifiée	2,13 %
Sociétés de financement	Autre	1,02 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (tels que définis par le Barclays Industry Classification System) : intégrés, indépendants, midstream, services du secteur pétrolier, raffinage.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

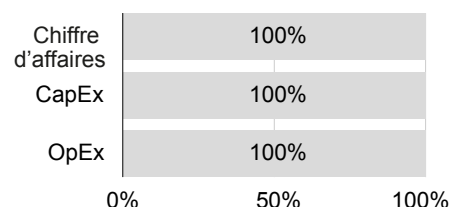
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

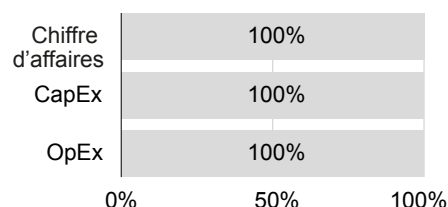
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 74,13 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 18,60 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités et des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et des agences du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Impact Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?

Sans objet.

Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?

Sans objet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Emerging Markets Sustainable Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300LB6Q9I4FRKNM72

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 52,79 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Exclusion des investissements dans des titres d'émetteurs impliqués dans : la production et la vente au détail de produits alcoolisés ; la propriété ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard ; les activités d'exploitation minière, de production et d'approvisionnement liées à l'énergie nucléaire ; la production de supports de divertissement pour adultes ; la production non conventionnelle de pétrole et de gaz ; la production d'armes conventionnelles.

Exclusion des émetteurs qui ne présentent pas une notation de B ou plus, comme défini par les notations ESG Intangible Value Assessment Ratings de MSCI ou un autre fournisseur de données ESG équivalent

Le Fonds n'investira pas dans les sociétés aux émissions de carbone les plus élevées, en termes d'intensité des émissions

Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI Emerging Markets Index (l'« Indice »)

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI Emerging Markets Index après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	52,79 %
Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI Emerging Markets Index	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-72,56 %
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI Emerging Markets Index après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : A (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 52,79 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un atteindre un objectif environnemental et/ou social.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Technologie de l'information	5,27 %	Taiwan (République de Chine)
Samsung Electronics Ltd	Technologie de l'information	4,71 %	Corée (du Sud), République de
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Technologie de l'information	3,61 %	Taiwan (République de Chine)
BLK ICS USD Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	3,22 %	Irlande
Alibaba Group Holding ADR Representing	Produits accessoires	2,31 %	Chine
Alibaba Group Holding Ltd	Produits accessoires	2,30 %	Chine
Samsung Electronics Non Voting Pre	Technologie de l'information	1,97 %	Corée (du Sud), République de
Axis Bank GDR Ltd	Finance	1,92 %	Inde
Walmart De Mexico V	Produits de consommation courante	1,90 %	Mexique
Hapvida Participacoes E Investimentos	Soins de santé	1,89 %	Brésil
GPO Finance Banorte	Finance	1,87 %	Mexique
Tencent Holdings ADR Ltd	Communication	1,82 %	Chine
KE Holdings ADR Representing Inc	Immobilier	1,79 %	Chine
Samsung Sdi Ltd	Technologie de l'information	1,77 %	Corée (du Sud), République de
HDFC Bank ADR Representing Three L	Finance	1,77 %	Inde

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

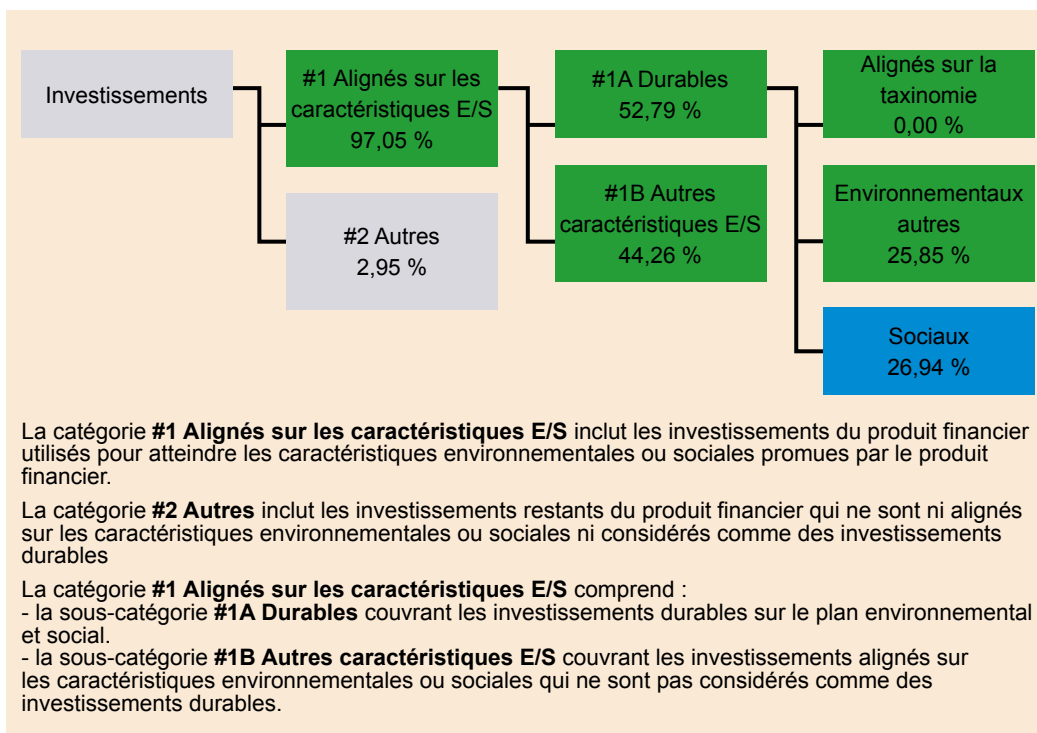
Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Finance	Banques	20,55 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	12,27 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	10,94 %
Finance	Services financiers	7,67 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	6,46 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	5,72 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	5,38 %
Communication	Médias et divertissement	4,38 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	4,22 %
Produits accessoires	Bien durables	3,60 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	3,10 %
Finance	Assurance	2,49 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	2,28 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	2,23 %
Matières premières	Matières premières	2,06 %
Produits industriels	Biens d'équipement	1,93 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	1,80 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	1,44 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,32 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

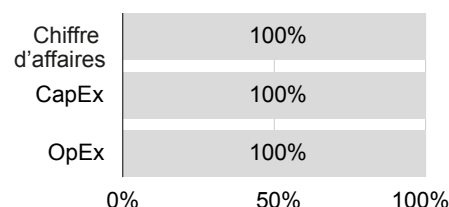
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

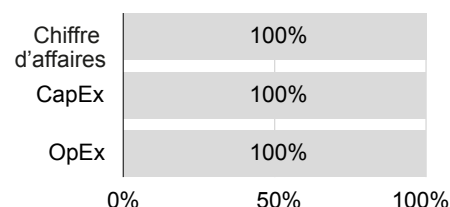
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 25,85 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 26,94 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, des actions ou parts d'OPC, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante : <https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Emerging Markets Sustainable Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Cautious Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
ESG Flex Choice Cautious Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300GIK6JDPSSL3Y45

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Réduction de 20 % de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détentions du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index (20 %) et au Bloomberg US Universal Index (80 %) (l'« Indice ») de 20 %

Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif et n'adoptent pas uniquement des filtres d'exclusion ESG en tant que politique ESG ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG dont le statut est conforme au Règlement SFDR, en particulier aux exigences énoncées à l'Article 8 et 9 du Règlement SFDR

Maintien d'une notation ESG supérieure à celle de l'Indice

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Cautious Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détections du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index (20 %) et au Bloomberg US Universal Index (80 %) de 20 %	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-54,19 %
Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif et n'adoptent pas uniquement des filtres d'exclusion ESG en tant que politique ESG ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG dont le statut est conforme au Règlement SFDR, en particulier aux exigences énoncées à l'Article 8 et 9 du Règlement SFDR	% de détections d'organismes de placement collectif sous-jacents	95,84 %
Maintien d'une notation ESG supérieure à celle de l'Indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : A (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice sur toute la période de référence)

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Cautious Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



- **Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

	Indicateur de durabilité
Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Maintien de l'intensité des émissions carbone du Fonds 20 % en dessous de celle de l'indice de référence du Fonds
Émissions de gaz à effet de serre (GES)	P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements	P

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Cautious Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
iShares \$ Corp Bond Esg Ucit Usd D	ETF	17,20 %	Irlande
iShares Usd Treasury Bond 3- Usd_D	ETF	13,11 %	Irlande
iShares \$ Treasury Bond 1-3Yr Ucits	ETF	8,71 %	Irlande
iShares \$ Tsy Bnd 20+Yr Ucits Usd Dist	ETF	7,39 %	Irlande
iShares Treas 7-10Yr Usd Dist Etf	ETF	6,45 %	Irlande
iShares Jpm Esg \$ Em Bond Usd D	ETF	5,48 %	Irlande
iShares \$ Hy Corp Bnd Esg Usd D	ETF	5,00 %	Irlande
iShares MSCI Usa Sri Ucits E Usd D	ETF	4,22 %	Irlande
iShares \$ Asia Ig Corp Bond Etf Usd A	ETF	3,97 %	Irlande
iShares \$ Corp Bond Esg 0-3Y Usd_D	ETF	3,62 %	Irlande
iShares MSCI World Esg Enhan Usd D	ETF	3,40 %	Irlande
iShares Global Agg Bond Esg Usd D	ETF	3,05 %	Irlande
iShares MSCI USA ESG Screened Dis	ETF	2,55 %	Irlande
iShares MSCI Em Esg Enhanced Usd D	ETF	2,21 %	Irlande
iShares MSCI Europe Sri Ucit Usda	ETF	2,09 %	Irlande

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

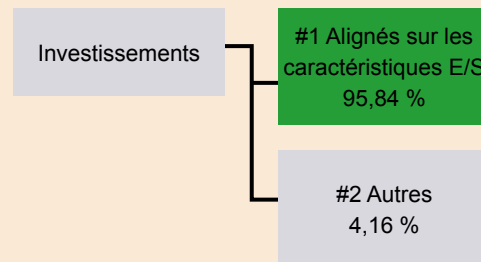
ESG Flex Choice Cautious Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Cautious Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Titres gouvernementaux	Titres gouvernementaux	44,89 %
Finance	Banques	7,84 %
Finance	Services financiers	5,60 %
Produits industriels	Biens d'équipement	3,35 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	3,22 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	2,61 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	2,60 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	2,54 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	2,44 %
Communication	Médias et divertissement	2,34 %
Matières premières	Matières premières	2,15 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	1,99 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	1,80 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	1,76 %
Communication	Télécommunications	1,67 %
Finance	Assurance	1,56 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	1,34 %
Produits industriels	Transports	1,30 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	1,21 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	0,75 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,47 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	0,36 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,23 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,16 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	0,06 %
Énergie	Charbon et combustibles	0,01 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Cautious Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

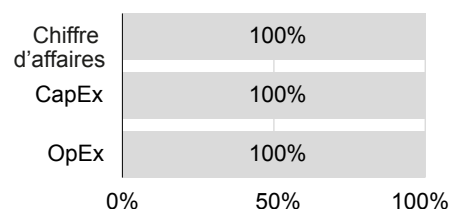
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

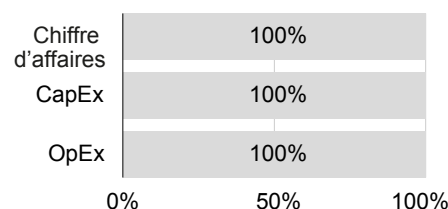
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Cautious Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Cautious Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Growth Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
ESG Flex Choice Growth Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300JAHFIIHVLNDNH65

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Le produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détections du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index (80 %) et au Bloomberg US Universal Index (20 %) (l'« Indice ») de 20 %

Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif et n'adoptent pas uniquement des filtres d'exclusion ESG en tant que politique ESG ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG dont le statut est conforme au Règlement SFDR, en particulier aux exigences énoncées à l'Article 8 et 9 du Règlement SFDR

Maintien d'une notation ESG supérieure à celle de l'Indice

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Growth Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détentions du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index (80 %) et au Bloomberg US Universal Index (20 %) de 20 %	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-44,86 %
Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif et n'adoptent pas uniquement des filtres d'exclusion ESG en tant que politique ESG ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG dont le statut est conforme au Règlement SFDR, en particulier aux exigences énoncées à l'Article 8 et 9 du Règlement SFDR	% de détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents	89,09 %
Maintien d'une notation ESG supérieure à celle de l'Indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice sur toute la période de référence)

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Growth Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité
	Maintien de l'intensité des émissions carbone du Fonds 20 % en dessous de celle de l'indice de référence du Fonds
Émissions de gaz à effet de serre (GES)	P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements	P

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Growth Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
iShares MSCI Usa Sri Ucits E Usd D	ETF	17,78 %	Irlande
iShares MSCI Usa Esg Enhance Usd D	ETF	13,34 %	Irlande
iShares MSCI World Esg Enhanc Usd D	ETF	10,11 %	Irlande
iShares MSCI Europe Sri Ucit Usda	ETF	9,39 %	Irlande
iShares MSCI Em Esg Enhanced Usd D	ETF	8,86 %	Irlande
iShares MSCI Usa Esg Screene Cdis	ETF	6,24 %	Irlande
iShares \$ Corp Bond Esg Ucit Usd D	ETF	5,82 %	Irlande
iShares Edg MSCI Wrld Mv Esg Usd Acc	ETF	3,42 %	Irlande
iShares MSCI Japan Sri Ucits Etf	ETF	2,90 %	Irlande
iShares MSCI Canada Etf \$ Acc	ETF	2,03 %	Irlande
iShares Global Clean Energy Ucits	ETF	1,96 %	Irlande
iShares \$ Tsy Bnd 20+Yr Ucits Usd Dist	ETF	1,87 %	Irlande
iShares MSCI Pac Ex-Jpn Esg Enh Usd A	ETF	1,72 %	Irlande
iShares \$ Tips Ucits Etf	ETF	1,47 %	Irlande
iShares Treas 7-10Yr Usd Dist Etf	ETF	1,39 %	Irlande

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

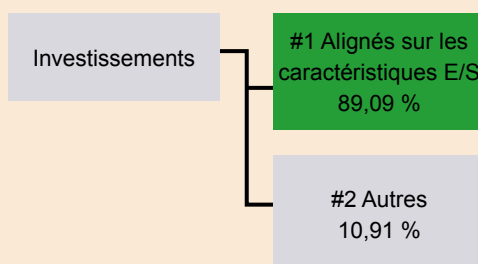
ESG Flex Choice Growth Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Growth Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Titres gouvernementaux	Titres gouvernementaux	8,65 %
Finance	Banques	7,16 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	6,98 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	6,03 %
Produits industriels	Biens d'équipement	6,02 %
Finance	Services financiers	5,83 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	5,37 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	4,49 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	4,29 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	4,12 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	4,02 %
Finance	Assurance	3,86 %
Matières premières	Matières premières	3,78 %
Communication	Médias et divertissement	3,51 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	3,17 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,18 %
Produits industriels	Transports	2,11 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	2,01 %
Communication	Télécommunications	1,99 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	1,88 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	1,73 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	1,50 %
Produits accessoires	Bien durables	1,38 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	1,28 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	0,81 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,70 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,56 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	0,38 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,27 %
Énergie	Charbon et combustibles	0,02 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	0,02 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Growth Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

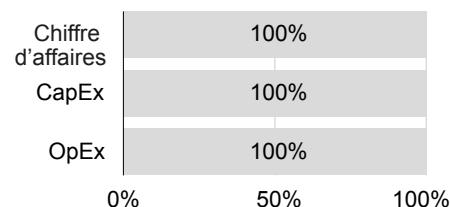
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

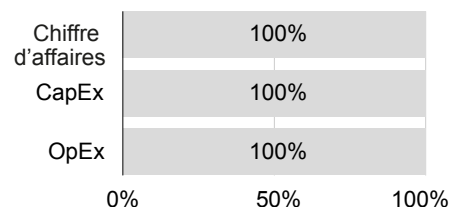
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Growth Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Growth Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Moderate Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
ESG Flex Choice Moderate Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300RNM9YKQG6BT311

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui **Non**

<p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___%</p>	<p><input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social <p><input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables</p>
--	---



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Réduction de 20 % de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détections du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index (60 %) et au Bloomberg US Universal Index (40 %) (l'« Indice ») de 20 %
 Détections d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif et n'adoptent pas uniquement des filtres d'exclusion ESG en tant que politique ESG ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG dont le statut est conforme au Règlement SFDR, en particulier aux exigences énoncées à l'Article 8 et 9 du Règlement SFDR
 Maintien d'une notation ESG supérieure à celle de l'Indice

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Moderate Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif et n'adoptent pas uniquement des filtres d'exclusion ESG en tant que politique ESG ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG dont le statut est conforme au Règlement SFDR, en particulier aux exigences énoncées à l'Article 8 et 9 du Règlement SFDR	% de détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents	93,32 %
Maintien d'une notation ESG supérieure à celle de l'Indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : A (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice sur toute la période de référence)
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détentions du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index (60 %) et au Bloomberg US Universal Index (40 %) de 20 %	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-48,12 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Moderate Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité
	Maintien de l'intensité des émissions carbone du Fonds 20 % en dessous de celle de l'indice de référence du Fonds
Émissions de gaz à effet de serre (GES)	P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements	P

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Moderate Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
iShares MSCI Usa Esg Enhance Usd D	ETF	13,16 %	Irlande
iShares MSCI Usa Sri Ucits E Usd D	ETF	12,13 %	Irlande
iShares \$ Corp Bond Esg Ucit Usd D	ETF	11,35 %	Irlande
iShares MSCI World Esg Enhan Usd D	ETF	7,52 %	Irlande
iShares MSCI Europe Sri Ucit Usda	ETF	7,00 %	Irlande
iShares MSCI Em Esg Enhanced Usd D	ETF	6,53 %	Irlande
iShares Usd Treasury Bond 3- Usd_D	ETF	5,68 %	Irlande
iShares \$ Tsy Bnd 20+Yr Ucits Usd Dist	ETF	3,48 %	Irlande
iShares Treas 7-10Yr Usd Dist Etf	ETF	2,72 %	Irlande
iShares MSCI Usa Esg Screene Cdis	ETF	2,49 %	Irlande
iShares Edg MSCI Wrld Mv Esg Usd Acc	ETF	2,42 %	Irlande
iShares MSCI Japan Sri Ucits Etf	ETF	2,21 %	Irlande
iShares Jpm Esg \$ Em Bond Usd D	ETF	2,17 %	Irlande
iShares \$ Treasury Bond 1-3Yr Ucit	ETF	2,04 %	Irlande
iShares Global Clean Energy Ucits	ETF	1,96 %	Irlande

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

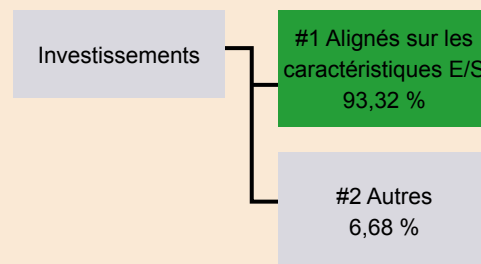
ESG Flex Choice Moderate Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Moderate Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Titres gouvernementaux	Titres gouvernementaux	18,88 %
Finance	Banques	7,67 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	5,85 %
Finance	Services financiers	5,82 %
Produits industriels	Biens d'équipement	5,15 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	4,95 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	4,49 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	3,86 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	3,47 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	3,41 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	3,41 %
Matières premières	Matières premières	3,21 %
Communication	Médias et divertissement	3,17 %
Finance	Assurance	3,11 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	3,02 %
Communication	Télécommunications	1,96 %
Produits industriels	Transports	1,87 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	1,85 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	1,84 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	1,48 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	1,42 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	1,34 %
Produits accessoires	Bien durables	1,14 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	1,10 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	0,80 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,60 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,50 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	0,35 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,22 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	0,03 %
Énergie	Charbon et combustibles	0,02 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Moderate Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

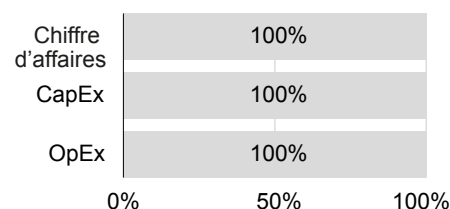
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

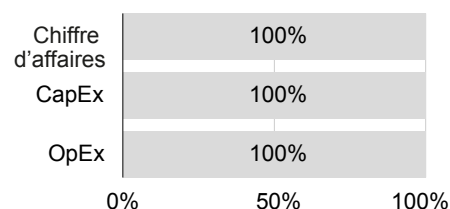
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Moderate Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Flex Choice Moderate Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
ESG Global Conservative Income Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300EH1PC6M8ZB0B86

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 43,28 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Amélioration du score ESG ajusté par rapport à l'univers d'investissement.

Maintien du score d'intensité des émissions carbone du Fonds (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes sur les détentions du Fonds) inférieur à celui de l'univers d'investissement du Fonds
Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Exclusion des émetteurs impliqués dans la production, la distribution et les licences de produits alcoolisés, la propriété ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard, les activités d'exploitation minière, les activités de production, d'approvisionnement et d'exploitation minière liées à l'énergie nucléaire et la production de supports de divertissement pour adultes.

Le Gestionnaire Financier par délégation minimisera l'exposition aux émetteurs ayant des notations ESG faibles dans chaque univers de classe d'actifs applicable.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien de l'intensité des émissions carbone du Fonds (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes sur les détentions du Fonds) inférieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds	Intensité des émissions carbone par rapport à l'univers d'investissement	-62,57 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Le Gestionnaire Financier par délégation minimisera l'exposition aux émetteurs ayant des notations ESG faibles dans chaque univers de classe d'actifs applicable.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	43,28 %
Amélioration du score ESG ajusté par rapport à l'univers d'investissement.	% d'amélioration du score ESG par rapport à l'univers d'investissement	11,89 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 43,28 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				Maintien de l'intensité des émissions de carbone du Fonds inférieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
iShares EU Corp Bond ESG Par Eur	ETF	3,76 %	Irlande
GNMA2 30YR	Securitized	2,57 %	États-Unis
iShares Green Bd (Ie) Fix Eur Dis	Fonds	2,03 %	Irlande
GNMA2 30YR	Securitized	1,83 %	États-Unis
GNMA2 30YR	Securitized	1,35 %	États-Unis
GNMA2 30YR	Securitized	0,95 %	États-Unis
GNMA2 30YR PLATINUM	Securitized	0,89 %	États-Unis
GNMA2 30YR 2012 PRODUCTION	Securitized	0,78 %	États-Unis
GNMA2 30YR	Securitized	0,77 %	États-Unis
Greencoat UK Wind Plc	Fonds	0,65 %	Royaume-Uni
GNMA2 30YR	Securitized	0,64 %	États-Unis
GNMA2 30YR	Securitized	0,61 %	États-Unis
Greencoat Renewables Plc	Corporates	0,55 %	Irlande
GNMA2 30YR	Securitized	0,53 %	États-Unis
GNMA2 30YR	Securitized	0,47 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

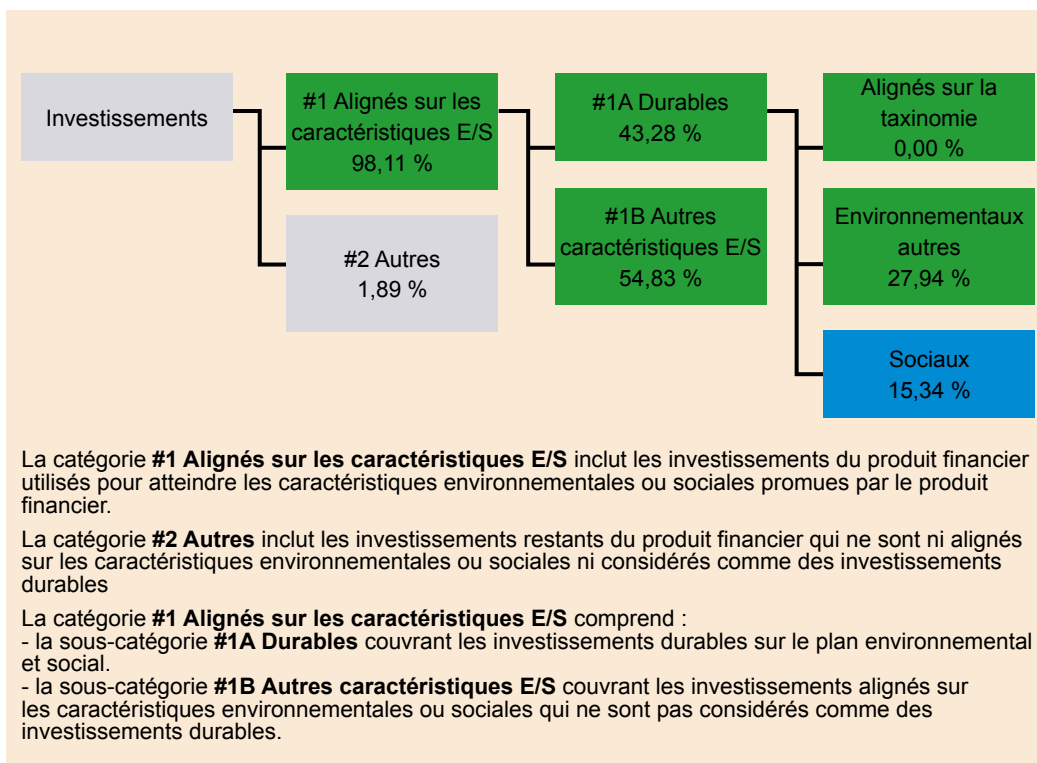
ESG Global Conservative Income Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Banques	Banques	24,64 %
Securitized	MBS Pass-Through	18,19 %
Technologie	Technologie	6,48 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	2,98 %
Communications	Câbles électriques	2,90 %
Communications	Wireless	2,78 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	2,66 %
Courtage	Courtage	2,63 %
/Gestionnaires d'actifs/Change	/Gestionnaires d'actifs/Change	
Biens de consommation non cyclique	Soins de santé	2,44 %
Électricité	Électricité	2,27 %
Autres secteurs financiers	Autres secteurs financiers	2,11 %
Communications	Câble et satellite	1,80 %
Transports	Services de transport	1,57 %
Biens de consommation non cyclique	Alimentation et boissons	1,49 %
Sociétés de financement	Sociétés de financement	1,40 %
Industrie de base	Produits chimiques	1,32 %
Biens d'équipement	Manufacture diversifiée	1,31 %
Biens de consommation cyclique	Services de consommation cyclique	1,20 %
Biens de consommation cyclique	Détaillants	1,15 %
Assurance	Biens et sinistres	1,14 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	0,74 %
Énergie	Indépendante	0,52 %
Énergie	Midstream	0,00 %
Énergie	Services de champ pétrolifère	0,00 %
Énergie	Raffinage	0,00 %
Énergie	Intégrée	0,00 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

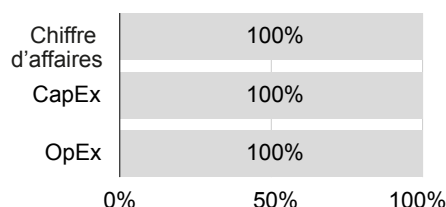
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

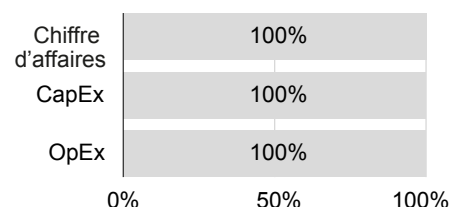
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 27,94 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables avec un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 15,34 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, de liquidités et de quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Conservative Income Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
ESG Global Multi-Asset Income Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300T4SANEU2BBDZ18

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 34,26 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Amélioration du score ESG ajusté par rapport à l'univers d'investissement

Maintien de l'intensité des émissions carbone du Fonds (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes sur les détentions du Fonds) inférieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Exclusion des investissements dans des titres d'émetteurs impliqués dans la production, la distribution et les licences de produits alcoolisés ; la propriété ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard ; les activités de production, d'approvisionnement et d'exploitation minière liées à l'énergie nucléaire ; la production de supports de divertissement pour adultes. Le Gestionnaire Financier par délégation minimisera l'exposition aux émetteurs ayant des notations ESG faibles dans chaque univers de classe d'actifs applicable.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien de l'intensité des émissions carbone du Fonds (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes sur les détentions du Fonds) inférieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds	Intensité des émissions carbone par rapport à l'univers d'investissement	-60,68 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Le Gestionnaire Financier par délégation limitera les investissements directs dans des titres d'émetteurs impliqués dans la production, la distribution et les licences de produits alcoolisés ; la propriété ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard ; les activités de production, d'approvisionnement et d'exploitation minière liées à l'énergie nucléaire ; la production de supports de divertissement pour adultes. Le Gestionnaire Financier par délégation minimisera l'exposition aux émetteurs ayant des notations ESG faibles dans chaque univers de classe d'actifs applicable.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	34,26 %
Amélioration du score ESG ajusté par rapport à l'univers d'investissement	% d'amélioration du score ESG par rapport à l'univers d'investissement	12,01 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 34,26 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)

et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

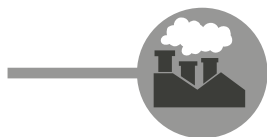
Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				Maintien de l'intensité des émissions de carbone du Fonds inférieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
iShares Eu Corp Bond Esg Par Eurha	ETF	3,95 %	Irlande
GNMA2 30YR	Securitized	2,68 %	États-Unis
iShares Green Bd (Ie) Flx Eur Dis	Fonds	2,64 %	Irlande
GNMA2 30YR	Securitized	2,35 %	États-Unis
FHLMC 30YR UMBS	Securitized	1,00 %	États-Unis
Greencoat Renewables Plc	Corporates	0,92 %	Irlande
Greencoat UK Wind Plc	Fonds	0,87 %	Royaume-Uni
GNMA2 30YR 2012 PRODUCTION	Securitized	0,77 %	États-Unis
FNMA 30YR UMBS	Securitized	0,67 %	États-Unis
SDCL Energy Efficiency Income Trus	Corporates	0,64 %	Royaume-Uni
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Corporates	0,54 %	Taiwan (République de Chine)
Clearway Energy Operating Llc 144A	Corporates	0,52 %	États-Unis
State Street Corp	Corporates	0,44 %	États-Unis
NMA 30Yr Umbs	Securitized	0,41 %	États-Unis
JPMorgan Chase & Co	Corporates	0,37 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

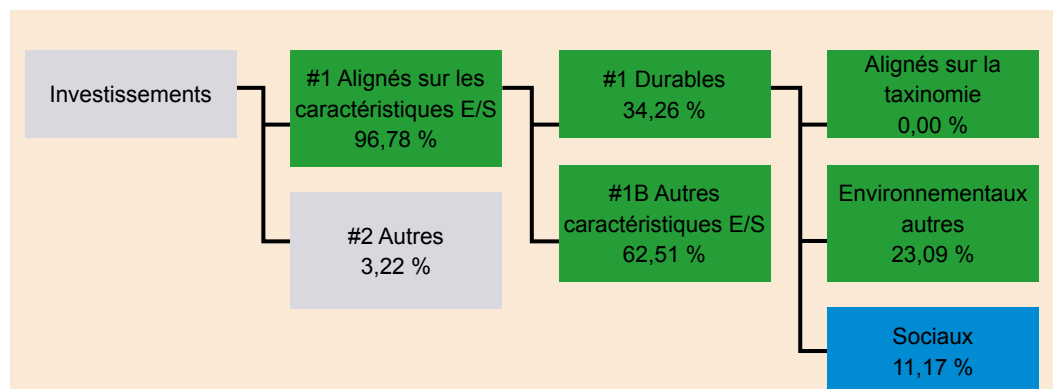
ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Banques	Banques	21,18 %
Technologie	Technologie	10,39 %
Securitized	MBS Pass-Through	9,15 %
Courtage	Courtage	4,16 %
/Gestionnaires d'actifs/Change	/Gestionnaires d'actifs/Change	
Biens de consommation non cyclique	Soins de santé	3,67 %
Électricité	Électricité	3,31 %
Communications	Câbles électriques	2,47 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	2,43 %
Communications	Wireless	2,16 %
Biens de consommation cyclique	Services de consommation cyclique	2,08 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	2,05 %
Biens de consommation non cyclique	Alimentation et boissons	1,96 %
Biens d'équipement	Manufacture diversifiée	1,89 %
Communications	Câble et satellite	1,88 %
Industrie de base	Produits chimiques	1,82 %
Biens de consommation cyclique	Détaillants	1,52 %
Biens d'équipement	Conditionnements	1,51 %
Assurance	Assurance-vie	1,50 %
Communications	Médias et divertissement	1,37 %
Industriel Autre Industriel	Autre	1,31 %
Sociétés de financement	Sociétés de financement	1,27 %
Assurance	Biens et sinistres	1,25 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	1,22 %
Gouvernemental	Agence	1,20 %
Énergie	Indépendante	0,93 %
Énergie	Services de champ pétrolifère	0,00 %
Énergie	Midstream	0,00 %
Énergie	Raffinage	0,00 %
Énergie	Intégrée	0,00 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

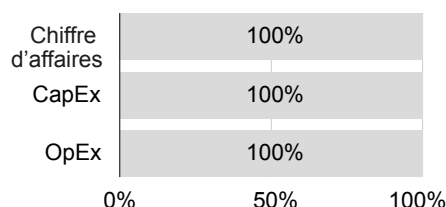
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

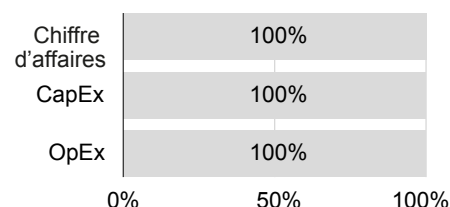
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 23,09 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 11,17 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, de liquidités et de quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Global Multi-Asset Income Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
ESG Multi-Asset Fund

Identifiant d'entité juridique :
54930062W9V3JFFCZF32

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 58,98 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de 50 % de l'indice MSCI World Index et de 50 % de Bloomberg après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice

Réduction de l'intensité des émissions de carbone (émissions pour 1 million \$ de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à 50 % du MSCI World Index et à 50 % du Bloomberg Global Aggregate Bond Index hedged to EUR

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Le Gestionnaire Financier par délégation limitera les investissements directs dans des titres d'émetteurs impliqués dans la production, la distribution et les licences de produits alcoolisés ; la propriété ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard ; les activités de production, d'approvisionnement et d'exploitation minière liées à l'énergie nucléaire ; la production de supports de divertissement pour adultes.

Exclusion des émetteurs dont la notation ESG est inférieure à BBB selon MSCI

Limiter à moins de 5 % du total de son actif les investissements dans les sociétés appartenant au secteur GICS (Global Industry Classification Standard) d'exploration et de production pétrolières et gazières ainsi que dans les sociétés appartenant au secteur GICS du pétrole et du gaz intégrés.

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Réduction de l'intensité des émissions de carbone (émissions pour 1 million \$ de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à 50 % du MSCI World Index et à 50 % du Bloomberg Global Aggregate Bond Index hedged to EUR	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-33,84 %
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de 50 % de l'indice MSCI World Index et de 50 % de Bloomberg après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	58,98 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Limiter à moins de 5 % du total de son actif les investissements dans les sociétés appartenant au secteur GICS (Global Industry Classification Standard) d'exploration et de production pétrolières et gazières ainsi que dans les sociétés appartenant au secteur GICS du pétrole et du gaz intégrés.	% des actifs totaux dans l'exploration et la production pétrolières et gazières ainsi que dans le pétrole et le gaz intégrés selon la classification GICS	0,10 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 58,98 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Réduction de l'intensité des émissions de carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P	
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Microsoft Corp	Technologie de l'information	3,73 %	États-Unis
Greencoat UK Wind Plc	Services aux collectivités	3,69 %	Royaume-Uni
iShares Physical Gold	Finance	2,23 %	Irlande
Billet de trésorerie	Trésor	2,22 %	États-Unis
Billet de trésorerie	Trésor	2,17 %	États-Unis
Allemagne (République fédérale d') RegS	Trésor	1,78 %	Allemagne
iShares MSCI Usa Sri Etf Usd Acc	Finance	1,43 %	Irlande
Syncona Limited Ltd Npv	Finance	1,41 %	Guernsey, Iles anglo-normandes
SDCL Energy Efficiency Income Trust	Finance	1,37 %	Royaume-Uni
Greencoat Renewables Plc	Services aux collectivités	1,19 %	Irlande
Gresham House Energy Storage Fund	Finance	1,15 %	Royaume-Uni
Union européenne Mtn RegS	Gouvernemental	1,04 %	Supranational
Allemagne (République fédérale d') RegS	Trésor	1,02 %	Allemagne
Schneider Electric	Produits industriels	1,00 %	France
Mastercard Inc Class A	Finance	0,97 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

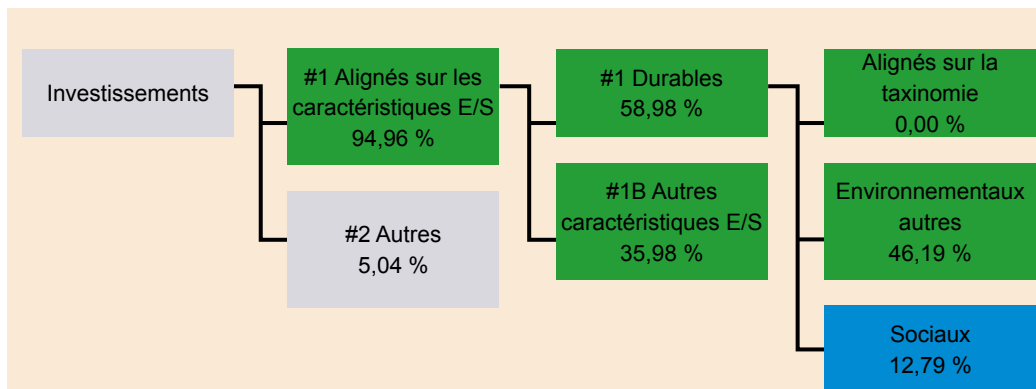
ESG Multi-Asset Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Titres gouvernementaux	Titres gouvernementaux	15,75 %
Finance	Services financiers	12,19 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	7,44 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	6,23 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	5,93 %
Finance	Banques	5,83 %
Produits industriels	Biens d'équipement	5,58 %
Matières premières	Matières premières	3,37 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	3,26 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	3,09 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	2,96 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	2,82 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	2,31 %
Autre	Autre	2,17 %
Produits industriels	Transports	2,10 %
Communication	Médias et divertissement	2,08 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,05 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	2,01 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	1,33 %
Finance	Assurance	1,20 %
Communication	Télécommunications	1,20 %
Produits accessoires	Bien durables	1,18 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	1,03 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	0,18 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,17 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,07 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	0,05 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,05 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	0,00 %
Énergie	Charbon et combustibles	0,00 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

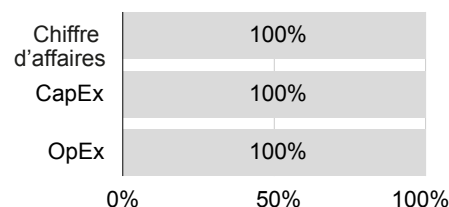
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

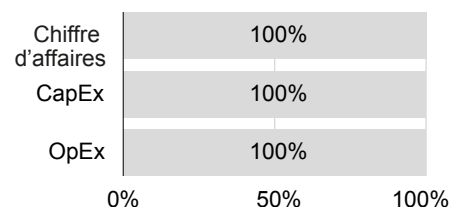
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 46,19 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 12,79 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Multi-Asset Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Euro-Markets Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300GXUXRC34JGKL97

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
LVMH	Produits accessoires	8,34 %	France
ASML Holding NV	Technologie de l'information	8,22 %	Pays-Bas
Schneider Electric	Produits industriels	4,26 %	France
Siemens N Ag	Produits industriels	3,88 %	Allemagne
BNP Paribas SA	Finance	3,23 %	France
ASM International NV	Technologie de l'information	2,84 %	Pays-Bas
Totalenergies	Énergie	2,80 %	France
Vinci Sa	Produits industriels	2,66 %	France
Pernod Ricard SA	Produits de consommation courante	2,64 %	France
IMCD NV	Produits industriels	2,46 %	Pays-Bas
Mtu Aero Engines Holding Ag	Produits industriels	2,45 %	Allemagne
STMicroelectronics NV	Technologie de l'information	2,44 %	Suisse
Dsv	Produits industriels	2,41 %	Danemark
Merck	Soins de santé	2,17 %	Allemagne
Ferrari NV	Produits accessoires	2,06 %	Italie

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

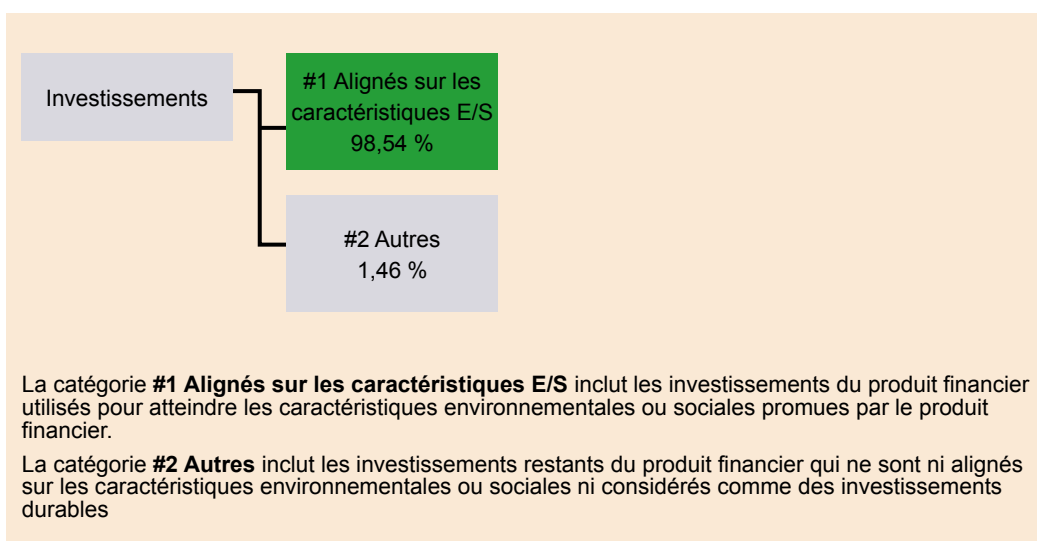
Euro-Markets Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	25,21 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	15,21 %
Produits accessoires	Bien durables	11,46 %
Finance	Banques	10,58 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	7,00 %
Matières premières	Matières premières	4,97 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	4,07 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	3,75 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	2,80 %
Produits industriels	Transports	2,78 %
Finance	Services financiers	2,66 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	2,33 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,06 %
Communication	Médias et divertissement	1,33 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	1,17 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	1,12 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,97 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

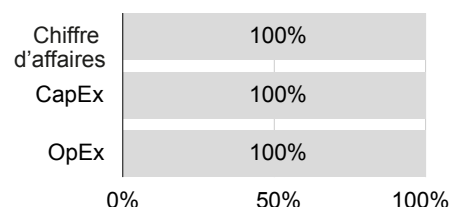
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

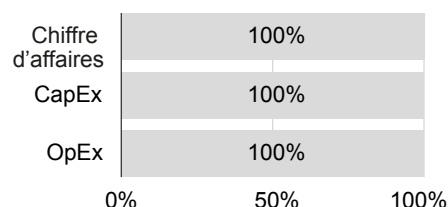
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Euro-Markets Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
European Equity Income Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300EO4UBXXE7L7Y87

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Novo Nordisk Class B	Soins de santé	3,92 %	Danemark
Astrazeneca Plc	Soins de santé	3,73 %	Royaume-Uni
Nestlé SA	Produits de consommation courante	3,54 %	Suisse
Vinci Sa	Produits industriels	3,47 %	France
Roche Holding Par Ag	Soins de santé	3,36 %	Suisse
BNP Paribas SA	Finance	3,36 %	France
Sampo	Finance	3,36 %	Finlande
ASML Holding NV	Technologie de l'information	3,27 %	Pays-Bas
Tryg	Finance	3,21 %	Danemark
Lonza Group AG	Soins de santé	3,04 %	Suisse
Sanofi Sa	Soins de santé	3,03 %	France
Zurich Insurance Group Ag	Finance	2,76 %	Suisse
LVMH	Produits accessoires	2,70 %	France
Schneider Electric	Produits industriels	2,22 %	France
Compagnie De Saint Gobain SA	Produits industriels	2,22 %	France

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

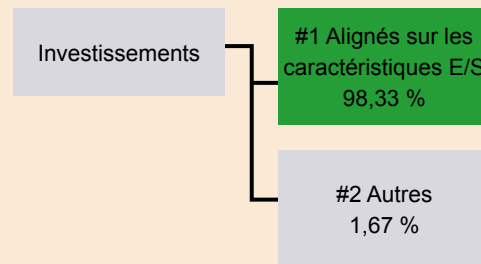
European Equity Income Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	18,63 %
Produits industriels	Biens d'équipement	18,61 %
Finance	Assurance	13,57 %
Finance	Banques	10,04 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	6,09 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	5,41 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	4,94 %
Matières premières	Matières premières	4,88 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	3,07 %
Produits accessoires	Bien durables	2,70 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	2,40 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	2,34 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	2,07 %
Communication	Télécommunications	1,41 %
Produits industriels	Transports	1,16 %
Finance	Services financiers	1,13 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

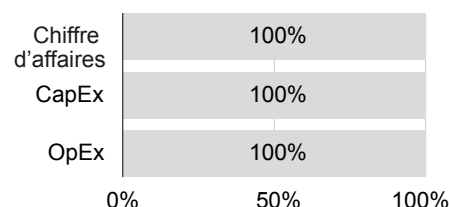
Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

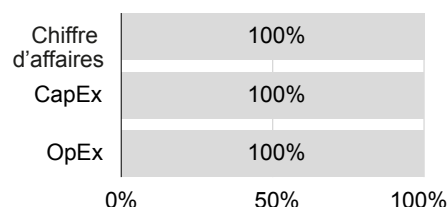
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Equity Income Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
European Focus Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300G4IU6YIF26IE36

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

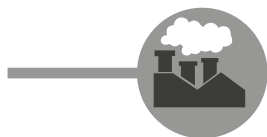
Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
LVMH	Produits accessoires	7,02 %	France
Novo Nordisk Class B	Soins de santé	6,89 %	Danemark
ASML Holding NV	Technologie de l'information	4,56 %	Pays-Bas
Lonza Group AG	Soins de santé	4,30 %	Suisse
RELX Plc	Produits industriels	3,86 %	Royaume-Uni
Dsv	Produits industriels	3,24 %	Danemark
Astrazeneca Plc	Soins de santé	3,18 %	Royaume-Uni
STMicroelectronics NV	Technologie de l'information	3,05 %	Suisse
L'Oréal SA	Produits de consommation courante	2,93 %	France
Mtu Aero Engines Holding Ag	Produits industriels	2,83 %	Allemagne
Sika Ag	Matières premières	2,76 %	Suisse
Ferrari NV	Produits accessoires	2,71 %	Italie
BLK Leaf Fund Agency Acc T0 Eur	Fonds mutuels	2,71 %	Irlande
BE Semiconductor Industries NV	Technologie de l'information	2,39 %	Pays-Bas
ASM International NV	Technologie de l'information	2,38 %	Pays-Bas

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

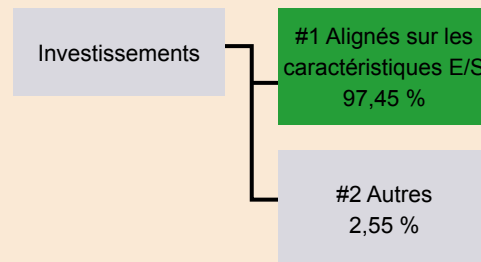
European Focus Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	17,45 %
Produits industriels	Biens d'équipement	15,93 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	12,38 %
Finance	Banques	8,98 %
Produits accessoires	Bien durables	8,87 %
Matières premières	Matières premières	6,73 %
Finance	Services financiers	5,69 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	4,19 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	3,97 %
Produits industriels	Transports	3,24 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	2,93 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,71 %
Communication	Médias et divertissement	1,90 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	1,63 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	1,23 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	1,23 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,50 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

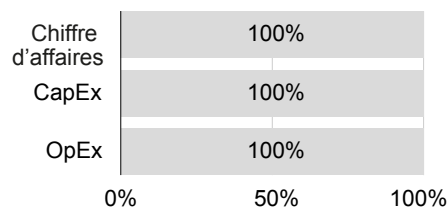
Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

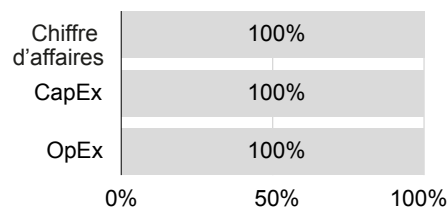
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Focus Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
European Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300NNK67YCMW4S660

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

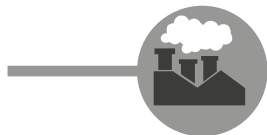
Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
LVMH	Produits accessoires	6,97 %	France
Novo Nordisk Class B	Soins de santé	6,88 %	Danemark
ASML Holding NV	Technologie de l'information	4,61 %	Pays-Bas
Lonza Group AG	Soins de santé	4,22 %	Suisse
RELX Plc	Produits industriels	3,79 %	Royaume-Uni
Dsv	Produits industriels	3,22 %	Danemark
Astrazeneca Plc	Soins de santé	3,10 %	Royaume-Uni
BLK Leaf Fund Agency Acc T0 Eur	Fonds mutuels	3,07 %	Irlande
STMicroelectronics NV	Technologie de l'information	3,05 %	Suisse
L'Oréal SA	Produits de consommation courante	2,91 %	France
Mtu Aero Engines Holding Ag	Produits industriels	2,85 %	Allemagne
Sika Ag	Matières premières	2,73 %	Suisse
Ferrari NV	Produits accessoires	2,68 %	Italie
BE Semiconductor Industries NV	Technologie de l'information	2,52 %	Pays-Bas
ASM International NV	Technologie de l'information	2,40 %	Pays-Bas

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

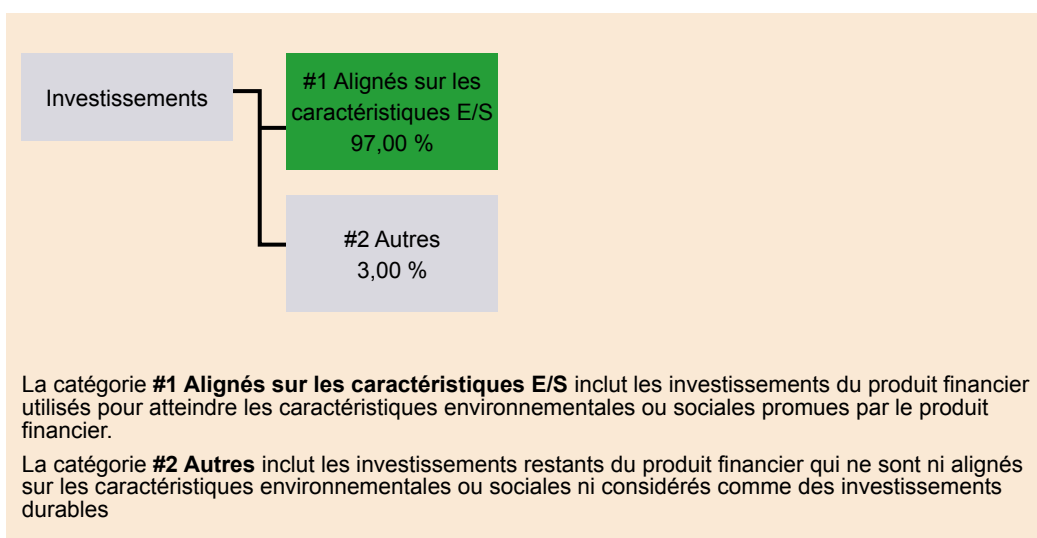
European Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	17,27 %
Produits industriels	Biens d'équipement	15,92 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	12,58 %
Produits accessoires	Bien durables	8,91 %
Finance	Banques	8,86 %
Matières premières	Matières premières	6,63 %
Finance	Services financiers	6,12 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	4,16 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	3,90 %
Produits industriels	Transports	3,22 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	2,91 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,68 %
Communication	Médias et divertissement	1,87 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	1,61 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	1,23 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	1,18 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,47 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

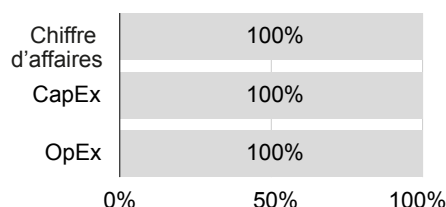
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

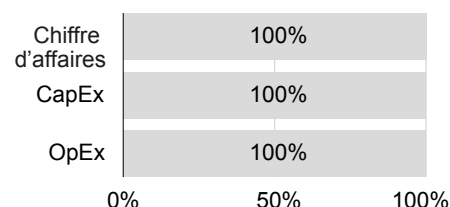
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
European High Yield Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300IZEHZ1BN5OFU72

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Rci Banque SA Regs 18/02/2030	Biens de consommation cyclique	1,64 %	France
Bellis Acquisition Company Plc Regs 16/02/2026	Biens de consommation non cyclique	1,10 %	Royaume-Uni
Intesa Sanpaolo Spa Pnc7,5 Regs 31/12/2079	Banques	0,98 %	Italie
Bayer Ag Nc5,5 Regs 25/03/2082	Biens de consommation non cyclique	0,94 %	Allemagne
Commerzbank Ag Regs 31/12/2079	Banques	0,87 %	Allemagne
Softbank Group Corp Regs 06/07/2024	Communications	0,86 %	Japon
Telefonica Europe Bv Regs 31/12/2079	Communications	0,84 %	Pays-Bas
Electricite De France SA Regs 31/12/2079	Gouvernemental	0,83 %	France
Liberty Mutual Group Inc Regs 23/05/2059	Assurance	0,82 %	États-Unis
Goldstory Sas Regs 01/03/2026	Biens de consommation cyclique	0,77 %	France
Vodafone Group Plc 60Nc6 Regs 27/08/2080	Communications	0,75 %	Royaume-Uni
Azzurra Aéroports Spa Regs 30/05/2024	Transports	0,72 %	Italie
Carnaval Corp Regs 01/02/2026	Biens de consommation cyclique	0,71%	Panama
Lorca Telecom Bondco Sau Regs 18/09/2027	Communications	0,71%	Espagne
Vodafone Group Plc Gbp 60Nc7 registres	Communication	0,69 %	Royaume-Uni

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

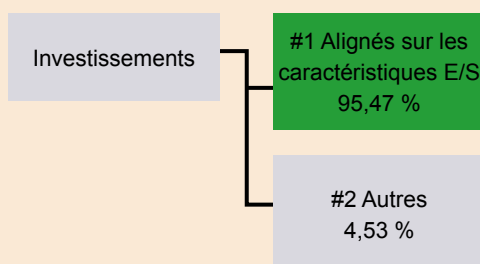
European High Yield Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Banques	Autre	12,72 %
Communications	Wireless	8,03 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	8,01 %
Communications	Câbles électriques	5,92 %
Autres secteurs financiers	Autre	5,64 %
Communications	Câble et satellite	5,39 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	4,94 %
Transports	Services de transport	4,03 %
de l'information	Autre	3,31 %
Industrie de base	Produits chimiques	2,80 %
Securitized	ABS	2,74 %
Gouvernemental	Agence	2,57 %
Biens d'équipement	Conditionnements	2,50 %
Biens de consommation cyclique	Services de consommation cyclique	2,43 %
Biens de consommation non cyclique	Supermarchés	2,18 %
Biens de consommation cyclique	Jeux	1,94 %
Biens d'équipement	Manufacture diversifiée	1,46 %
Communications	Médias et divertissement	1,46 %
Transports	Compagnies aériennes	1,41 %
Biens de consommation cyclique	Détaillants	1,38 %
Assurance	Biens et sinistres	1,38 %
Biens de consommation cyclique	Loisirs	1,30 %
Autres industries	Autre	1,08 %
Énergie	Intégrée	0,54 %
Énergie	Midstream	0,52 %
Énergie	Raffinage	0,39 %
Énergie	Indépendante	0,38 %
Énergie	Services de champ pétrolière	0,21 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

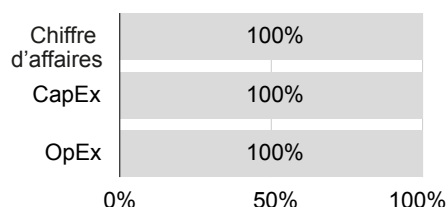
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

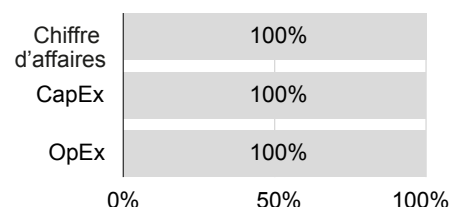
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European High Yield Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
European Special Situations Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300HWH5C0EBD7MS76

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
LVMH	Produits accessoires	6,77 %	France
Novo Nordisk Class B	Soins de santé	6,35 %	Danemark
ASML Holding NV	Technologie de l'information	4,49 %	Pays-Bas
Lonza Group AG	Soins de santé	4,10 %	Suisse
RELX Plc	Produits industriels	3,76 %	Royaume-Uni
Dsv	Produits industriels	3,08 %	Danemark
Astrazeneca Plc	Soins de santé	3,04 %	Royaume-Uni
STMicroelectronics NV	Technologie de l'information	2,98 %	Suisse
L'Oréal SA	Produits de consommation courante	2,88 %	France
Mtu Aero Engines Holding Ag	Produits industriels	2,74 %	Allemagne
Sika Ag	Matières premières	2,72 %	Suisse
Ferrari NV	Produits accessoires	2,60 %	Italie
ASM International NV	Technologie de l'information	2,29 %	Pays-Bas
BE Semiconductor Industries NV	Technologie de l'information	2,28 %	Pays-Bas
Pernod Ricard SA	Produits de consommation courante	2,24 %	France

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

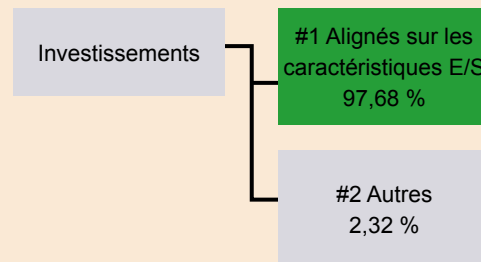
European Special Situations Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	18,15 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	16,35 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	12,04 %
Finance	Banques	8,79 %
Produits accessoires	Bien durables	8,63 %
Matières premières	Matières premières	6,59 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	5,10 %
Finance	Services financiers	4,82 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	3,86 %
Produits industriels	Transports	3,08 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	2,88 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,60 %
Communication	Médias et divertissement	1,66 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	1,63 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	1,47 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	1,10 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,45 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

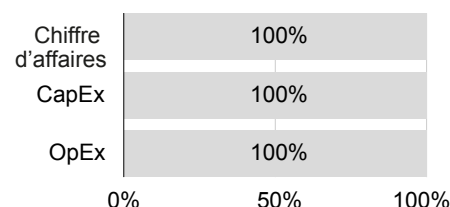
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

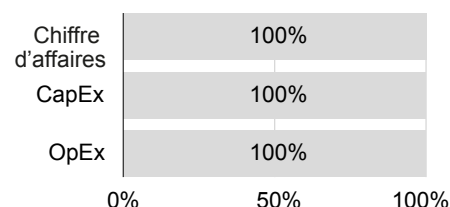
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Special Situations Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
European Sustainable Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300FPZK8Q36WIPB73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 84,20 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Limiter les investissements directs dans des titres d'émetteurs impliqués dans : la production et la vente au détail de produits alcoolisés ; la propriété ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard ; les activités d'exploitation minière, de production et d'approvisionnement liées à l'énergie nucléaire ; la production de supports de divertissement pour adultes ; la production non conventionnelle de pétrole et de gaz ; la production d'armes conventionnelles.

Exclusion des émetteurs qui ne présentent pas une notation de B ou plus, comme défini par les notations ESG Intangible Value Assessment Ratings de MSCI ou un autre fournisseur de données ESG équivalent

Maintien de la réduction par la politique ESG de l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 % par rapport au MSCI Europe Index (l'« Indice »)

Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI Europe Index

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien de la réduction par la politique ESG de l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 % par rapport au MSCI Europe Index.	Réduction de l'univers d'investissement	La politique ESG a réduit l'univers d'investissement de plus de 20 % sur la période de référence
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI Europe Index	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-52,87 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	84,20 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 84,20 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un atteindre un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

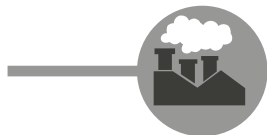
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Réduction de l'intensité des émissions de carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P	
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Novo Nordisk Class B	Soins de santé	8,55 %	Danemark
ASML Holding NV	Technologie de l'information	6,10 %	Pays-Bas
Astrazeneca Plc	Soins de santé	4,44 %	Royaume-Uni
Schneider Electric	Produits industriels	4,23 %	France
Lonza Group AG	Soins de santé	3,97 %	Suisse
Nestlé SA	Produits de consommation courante	3,81 %	Suisse
Atlas Copco Class A	Produits industriels	3,55 %	Suède
ASM International NV	Technologie de l'information	3,29 %	Pays-Bas
Alfa Laval	Produits industriels	3,24 %	Suède
Sika Ag	Matières premières	2,98 %	Suisse
RELX Plc	Produits industriels	2,82 %	Royaume-Uni
Stmicroelectronics Nv	Technologie de l'information	2,57 %	Suisse
CaixaBank SA	Finance	2,51 %	Espagne
Merck	Soins de santé	2,47 %	Allemagne
Mtu Aero Engines Holding Ag	Produits industriels	2,44 %	Allemagne

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

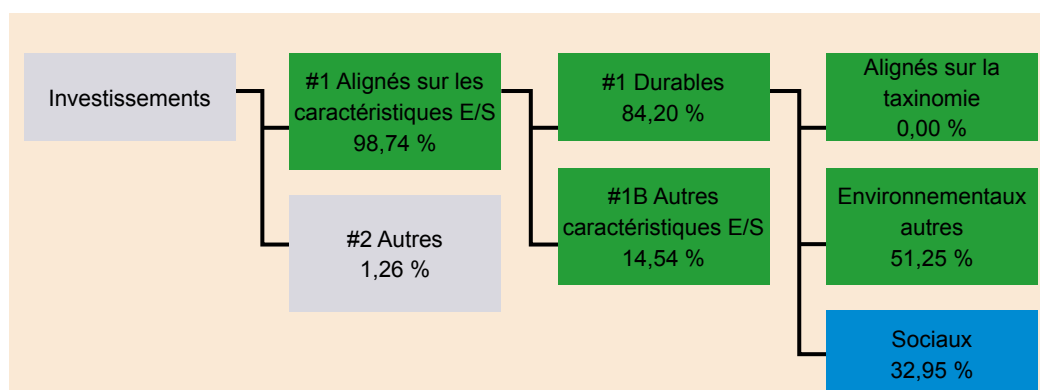
European Sustainable Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	28,12 %
Produits industriels	Biens d'équipement	24,81 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	13,19 %
Matières premières	Matières premières	10,47 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	4,85 %
Finance	Banques	4,83 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	3,81 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	2,79 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	2,45 %
Finance	Assurance	1,40 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	1,31 %
Finance	Services financiers	1,06 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,71 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

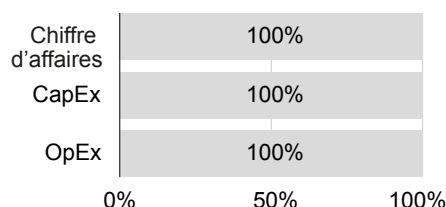
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

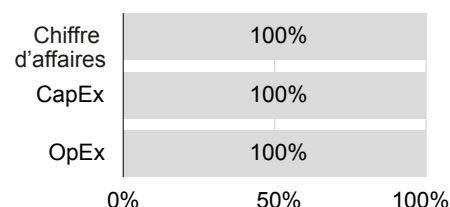
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 51,25 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables avec un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 32,95 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

European Sustainable Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
European Value Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300VTJEFQIEUK4533

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bp Plc	Énergie	4,23 %	Royaume-Uni
Rwe Ag	Services aux collectivités	3,50 %	Allemagne
Astrazeneca Plc	Soins de santé	3,49 %	Royaume-Uni
Shell Plc	Énergie	3,26 %	Royaume-Uni
Zurich Insurance Group Ag	Finance	3,20 %	Suisse
UniCredit	Finance	3,16 %	Italie
Compagnie De Saint Gobain SA	Produits industriels	3,02 %	France
Nordea Bank	Finance	2,96 %	Finlande
Vinci Sa	Produits industriels	2,85 %	France
Bank of Ireland Group Plc	Finance	2,62 %	Irlande
Schneider Electric	Produits industriels	2,50 %	France
Hsbc Holdings Plc	Finance	2,35 %	Royaume-Uni
STMicroelectronics NV	Technologie de l'information	2,35 %	Suisse
Upm-Kymmene	Matières premières	2,33 %	Finlande
Mercedes-Benz Group N Ag	Produits accessoires	2,30 %	Allemagne

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

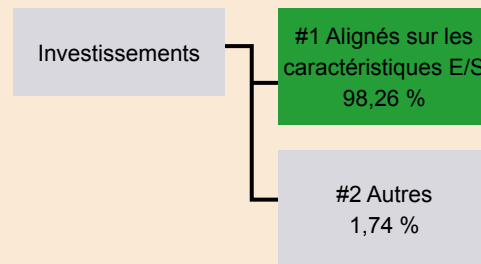
European Value Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	22,38 %
Finance	Banques	17,94 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	13,13 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	9,40 %
Finance	Assurance	6,04 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	5,75 %
Produits industriels	Transports	3,81 %
Matières premières	Matières premières	3,42 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	2,35 %
Produits accessoires	Bien durables	2,33 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,30 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	2,20 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	2,07 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	2,00 %
Finance	Services financiers	1,57 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	1,12 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

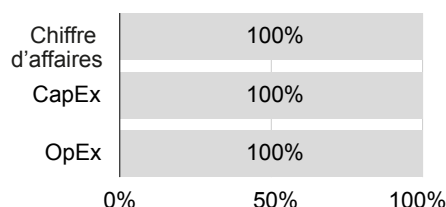
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

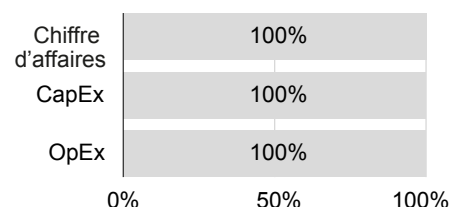
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

European Value Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
FinTech Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300QETL4YMSWPEO04

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

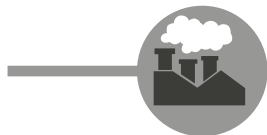
Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles			P	P
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Global Payments, Inc.	Finance	4,89 %	États-Unis
Fidelity National Information Serv	Finance	4,86 %	États-Unis
Fiserv Inc	Finance	4,81 %	États-Unis
Jsc Kaspi Kz Global Sponsored Reg	Finance	4,80 %	Kazakhstan
WEX, Inc.	Finance	4,72 %	États-Unis
American Express	Finance	3,87 %	États-Unis
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Finance	3,81 %	Irlande
Synchrony Financial	Finance	3,71 %	États-Unis
Pagseguro Digital Ltd Class A	Finance	3,60 %	Brésil
Capital One Financial Corp	Finance	3,49 %	États-Unis
Nuvei Subordinate Voting Corp	Finance	3,37 %	Canada
Black Knight Inc	Technologie de l'information	3,30 %	États-Unis
Xp Class A Inc	Finance	2,68 %	Brésil
Paypal Holdings Inc	Finance	2,64 %	États-Unis
Network International Holdings Plc	Technologie de l'information	2,63 %	Émirats arabes unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

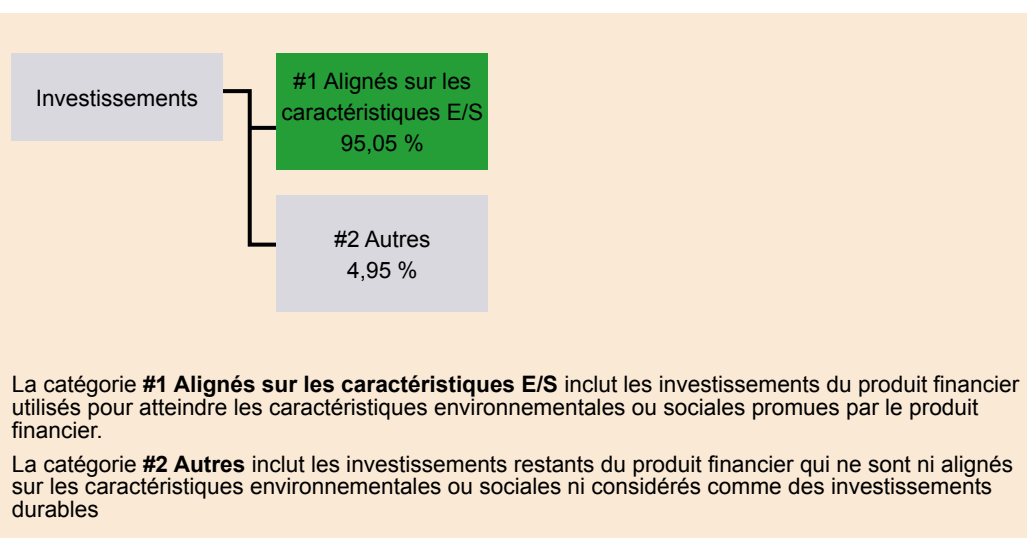
FinTech Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Finance	Services financiers	72,57 %
Finance	Banques	15,60 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	10,70 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

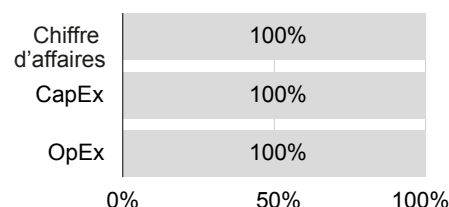
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

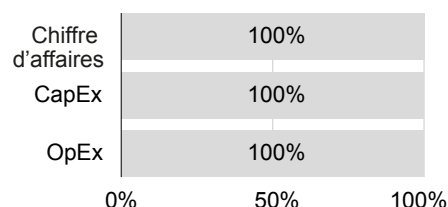
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



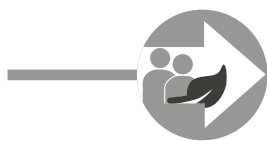
● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

FinTech Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Future Consumer Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493004TGOBEAE3VS848

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption) Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI All Countries World Index (l'« Indice »).

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI All Countries World Index.	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-15,14 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P	
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% actifs	Pays
Beiersdorf AG	Produits de consommation courante	5,89 %	Allemagne
Mastercard Inc Class A	Finance	5,59 %	États-Unis
Sony Group Corp.	Produits accessoires	4,96 %	Japon
Amazon Com Inc	Produits accessoires	4,28 %	États-Unis
Zoetis Inc Class A	Soins de santé	3,49 %	États-Unis
Reliance Industries Gdr Representi 144A	Énergie	3,37 %	Inde
L'Oréal SA	Produits de consommation courante	3,37 %	France
T Mobile Us Inc	Communication	3,01 %	États-Unis
Meta Platforms Inc Catégorie A	Communication	2,99 %	États-Unis
Cellnex Telecom Sa	Communication	2,96 %	Espagne
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	2,73 %	Irlande
Tencent Holdings Ltd	Communication	2,48 %	Chine
Walt Disney	Communication	2,44 %	États-Unis
Nike Inc Classe B	Produits accessoires	2,42 %	États-Unis
Heineken NV	Produits de consommation courante	2,36 %	Pays-Bas

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

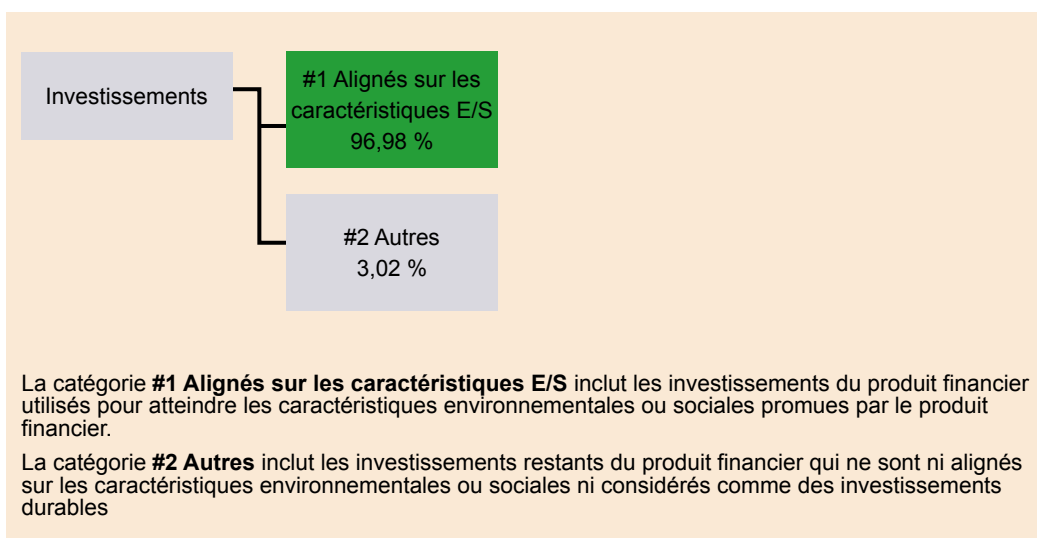
Future Consumer Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Communication	Médias et divertissement	15,45 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	11,41 %
Produits accessoires	Bien durables	11,04 %
Finance	Services financiers	10,49 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	10,30 %
Communication	Télécommunications	5,97 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	5,25 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	4,72 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	4,31 %
Matières premières	Matières premières	3,70 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	3,37 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	3,10 %
Produits industriels	Transports	2,46 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	2,24 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	1,83 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	1,53 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	1,08 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

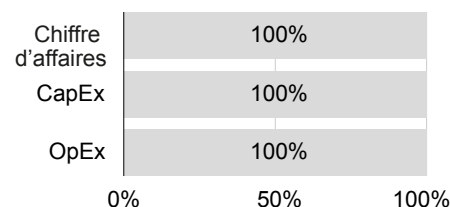
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

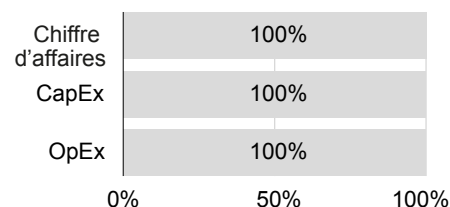
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Consumer Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dénomination du produit :
Future Of Transport Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300Y7OU6TK8YJHB08

Objectif d'investissement durable

Le produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 75,12 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 15,62 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'Investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'Investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI All Countries World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI All Countries World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	90,74 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexacts ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Émissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)
Empreinte carbone
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
Rejets dans l'eau
Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales
Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales
Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
Mixité au sein des organes de gouvernance
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, munitions à fragmentation, armes chimiques et biologiques)
Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

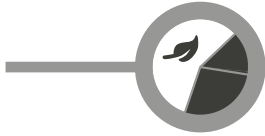
La liste comprend les investissements constituant la **plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BLK ICS USD Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	5,73 %	Irlande
Aptiv Plc	Produits accessoires	3,49 %	Irlande
Infineon Technologies AG	Technologie de l'information	3,48 %	Allemagne
TE Connectivity Ltd.	Technologie de l'information	3,47 %	Suisse
LG Chem Ltd	Matières premières	3,47 %	Corée (du Sud), République de
Samsung Sdi Ltd	Technologie de l'information	3,47 %	Corée (du Sud), République de
Schneider Electric	Produits industriels	3,45 %	France
Sensata Technologies Holding Plc	Produits industriels	3,45 %	États-Unis
Ansys Inc	Technologie de l'information	3,41 %	États-Unis
Dassault Systemes	Technologie de l'information	3,35 %	France
Stmicroelectronics Nv	Technologie de l'information	3,34 %	Suisse
Analog Devices Inc	Technologie de l'information	3,29 %	États-Unis
Cadence Design Systems Inc	Technologie de l'information	3,25 %	États-Unis
Eaton Plc	Produits industriels	3,22 %	Irlande
Albemarle Corp	Matières premières	3,14 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

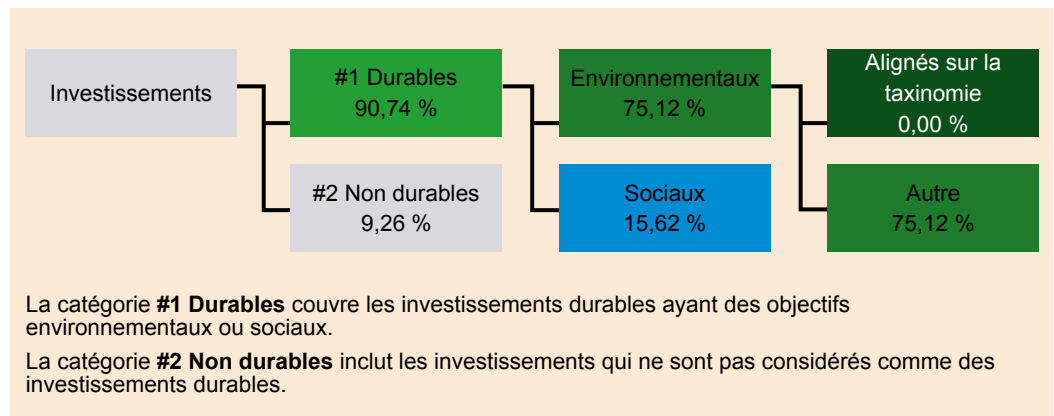
Future Of Transport Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	22,93 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	21,63 %
Matières premières	Matières premières	13,79 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	10,01 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	9,73 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	8,31 %
Finance	Services financiers	5,73 %
Produits industriels	Transports	2,92 %
Communication	Médias et divertissement	2,45 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	2,02 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,42 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

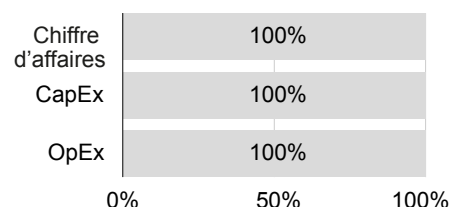
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

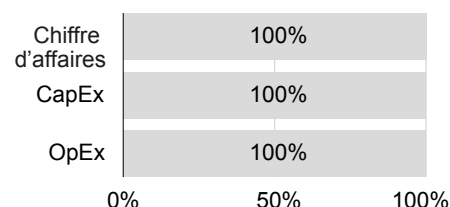
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables** sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 75,12 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 15,62 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Future Of Transport Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Global Equity Income Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493003EIFVTQB3EDS83

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 14 décembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Microsoft Corp	Technologie de l'information	4,42 %	États-Unis
Astrazeneca Plc	Soins de santé	2,94 %	Royaume-Uni
Sanofi Sa	Soins de santé	2,91 %	France
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Technologie de l'information	2,87 %	Taiwan (République de Chine)
Accenture Plc Class A	Technologie de l'information	2,74 %	Irlande
AbbVie, Inc.	Soins de santé	2,54 %	États-Unis
Paychex, Inc.	Produits industriels	2,37 %	États-Unis
Unitedhealth Group Inc	Soins de santé	2,36 %	États-Unis
TELUS Corp.	Communication	2,31 %	Canada
RELX Plc	Produits industriels	2,23 %	Royaume-Uni
Intercontinental Exchange Inc	Finance	2,21 %	États-Unis
Zurich Insurance Group Ag	Finance	2,18 %	Suisse
Otis Worldwide Corp	Produits industriels	2,15 %	États-Unis
Prudential Plc	Finance	2,15 %	Royaume-Uni
United Parcel Service Inc Classe B	Produits industriels	2,14 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

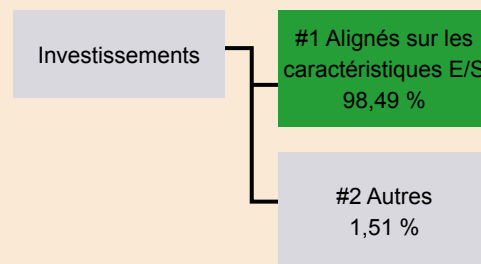
Global Equity Income Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	12,46 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	9,58 %
Finance	Services financiers	6,70 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	6,35 %
Produits industriels	Biens d'équipement	6,20 %
Finance	Banques	6,04 %
Finance	Assurance	5,84 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	5,75 %
Communication	Télécommunications	5,33 %
Produits accessoires	Bien durables	4,99 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	4,74 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	4,24 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	3,96 %
Matières premières	Matières premières	3,11 %
Produits industriels	Transports	2,62 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	2,11 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	2,05 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	2,01 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	1,69 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	1,45 %
Communication	Médias et divertissement	1,27 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	1,03 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

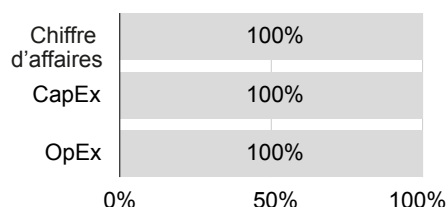
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

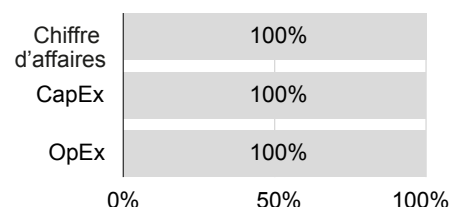
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental** au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Equity Income Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Global Government Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300ZROVR8S4X5V054

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 14,59 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'univers d'investissement

Évitement des externalités négatives par rapport à l'univers d'investissement

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	14,59 %
Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'univers d'investissement	Investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds par rapport à l'univers d'investissement	527,66 % supérieur à l'Indice
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	11,78 %
Évitement des externalités négatives par rapport à l'univers d'investissement	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 14,59 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'univers d'investissement	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique					P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 14 décembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Allemagne (République fédérale d') RegS 15/10/2027	Trésor	6,59 %	Allemagne
Bon de trésorerie 31/05/2025	Trésor	3,38 %	États-Unis
Bon de trésorerie 30/06/2025	Trésor	1,63 %	États-Unis
Bon de trésorerie 15/08/2032	Trésor	1,57 %	États-Unis
Bon de trésorerie 31/08/2027	Trésor	1,46 %	États-Unis
Allemagne (République fédérale d') RegS 12/06/2025	Trésor	1,39 %	Allemagne
Espagne (Royaume d') 31/10/2032	Trésor	1,37 %	Espagne
Japon (gouvernement du) 30 ans #74 20/03/2052	Trésor	1,19 %	Japon
Japon (Gouvernement du) #1136 15/05/2023	Trésor	1,05 %	Japon
Bon de trésorerie 31/03/2027	Trésor	1,05 %	États-Unis
France (République de) RegS 25/02/2027	Trésor	1,04 %	France
Banque européenne d'investissement Mtn 15/10/2025	Gouvernemental	1,01 %	Supranational
Bon de trésorerie (ancien) 31/01/2025	Trésor	1,01 %	États-Unis
Bon de trésorerie 31/07/2024	Trésor	0,90 %	États-Unis
Allemagne (République fédérale d') RegS 10/10/2025	Trésor	0,87 %	Allemagne

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

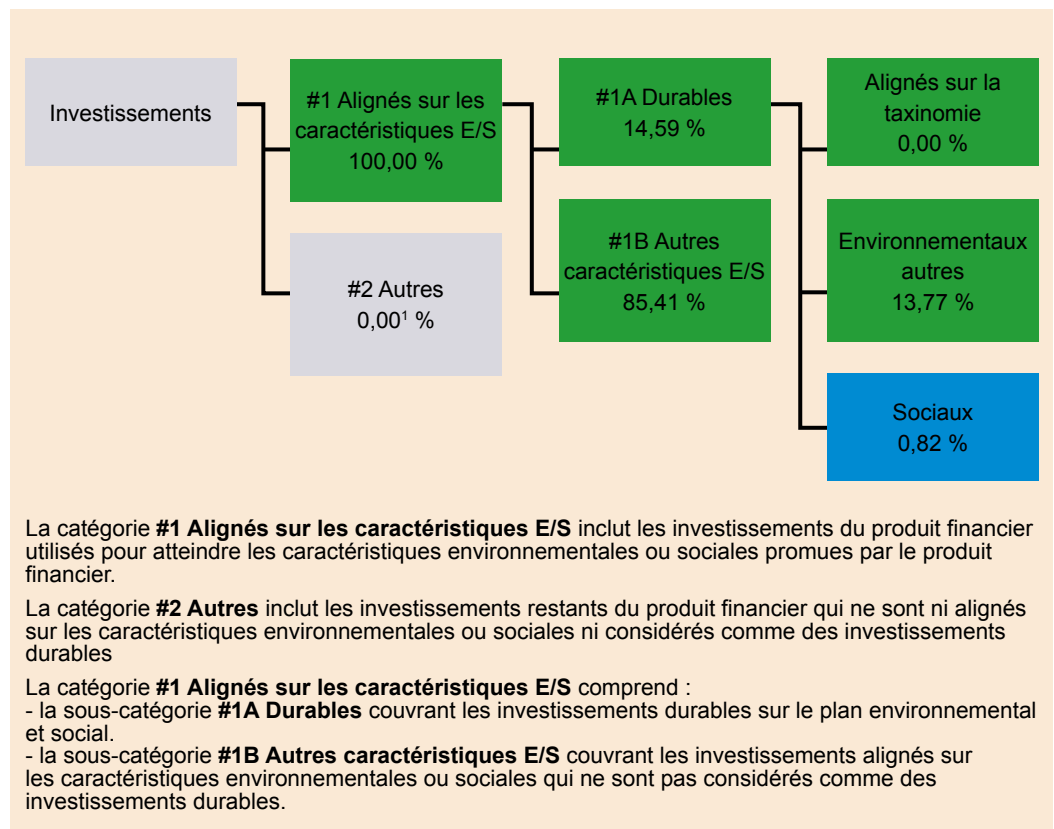
Global Government Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



¹ L'exposition nette aux « Autres » actifs a été de -0,26 % en raison des positions dans des instruments dérivés détenues sur le Fonds.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Trésor	Trésor	77,36 %
Securitized	ABS	8,47 %
Securitized	MBS Pass-Through	3,00 %
Banques	Autre	2,65 %
Securitized	CMBS	2,05 %
Gouvernemental	Supranational	1,81 %
Énergie	Midstream	0,14 %
Énergie	Intégrée	0,03 %
Énergie	Raffinage	0,02 %
Énergie	Indépendante	0,00 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : services de champ pétrolifère, métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

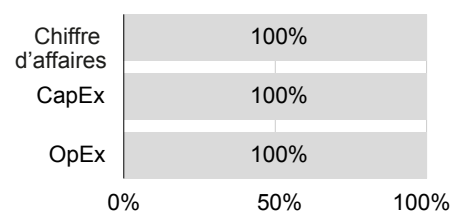
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

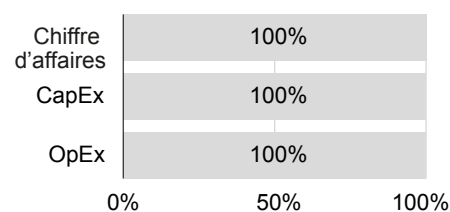
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 13,77 % des investissements du Fonds ont été classés comme des Investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 0,82 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Global Government Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Global High Yield Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300FVQG82AXR0U687

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

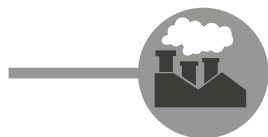
Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Clarios Global Lp 144A 15/05/2027	Biens de consommation cyclique	0,65 %	Canada
Picard Midco Inc 144A 31/03/2029	Technologie	0,63 %	États-Unis
Zayo Group Holdings Inc 144A 01/03/2027	Communications	0,49 %	États-Unis
Mauser Packaging Solutions Holding 144A 15/08/2026	Biens d'équipement	0,47 %	États-Unis
Alliant Holdings Intermediate Llc 144A 15/10/2027	Assurance	0,46 %	États-Unis
Carnival Holdings (Bermudes) Ltd 144A 01/05/2028	Biens de consommation cyclique	0,46 %	Bermudes
Verscend Escrow Corp 144A 15/08/2026	Technologie	0,43 %	États-Unis
Teva Pharmaceutical Finance Nether 01/10/2026	Biens de consommation non cyclique	0,42 %	Pays-Bas
Entegris Escrow Corp 144A 15/04/2029	Technologie	0,38 %	États-Unis
Nfp Corp 144A 15/08/2028	Courtage/Gestionnaires d'actifs/Échanges	0,37 %	États-Unis
Chobani Llc 144A 15/04/2025	Biens de consommation non cyclique	0,37 %	États-Unis
Connect Finco Sarl 144A 01/10/2026	Communications	0,37 %	Luxembourg
United Rentals (North America) Inc 144A 15/12/2029	Biens d'équipement	0,35 %	États-Unis
Rci Banque SA Regs 18/02/2030	Biens de consommation cyclique	0,34 %	France
Element Solutions Inc 144A 01/09/2028	Industrie de base	0,34 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

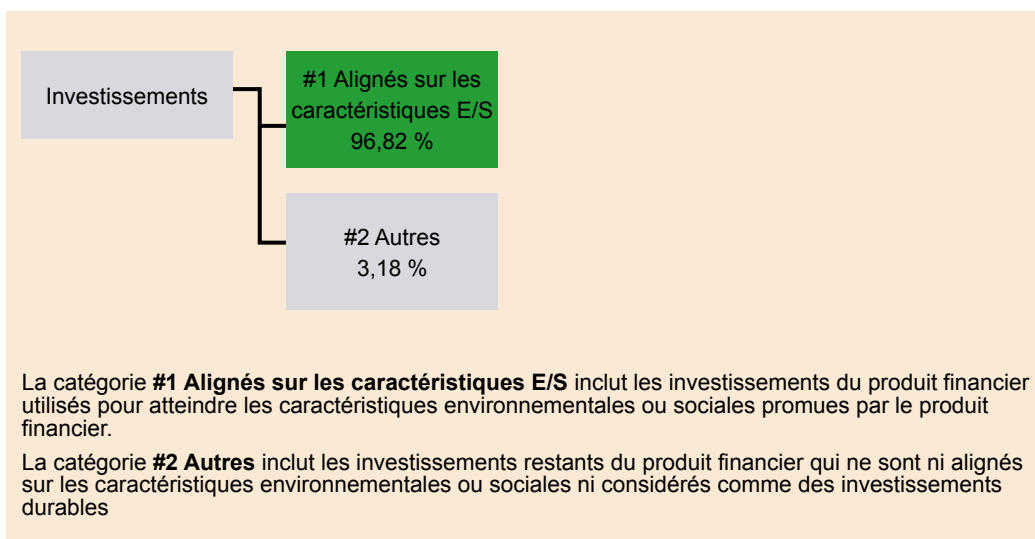
Global High Yield Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Technologie	Autre	8,82 %
Banques	Autre	5,26 %
Communications	Câble et satellite	4,61 %
Énergie	Midstream	4,26 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	4,17 %
Communications	Câbles électriques	4,12 %
Énergie	Indépendante	3,99 %
Communications	Wireless	3,60 %
Biens de consommation cyclique	Services de consommation cyclique	3,50 %
Biens de consommation cyclique	Jeux	3,27 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	3,15 %
Gouvernemental	Agence	2,97 %
Biens de consommation cyclique	Loisirs	2,96 %
Industrie de base	Produits chimiques	2,88 %
Biens de consommation non cyclique	Soins de santé	2,63 %
Biens d'équipement	Conditionnements	2,62 %
Biens d'équipement	Manufacture diversifiée	2,51 %
Autres secteurs financiers	Autre	2,14 %
Assurance	Biens et sinistres	2,12 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	2,12 %
Biens d'équipement	Matériaux de construction	2,11 %
Communications	Médias et divertissement	1,88 %
Securitized	ABS	1,87 %
Biens de consommation non cyclique	Alimentation et boissons	1,87 %
Transports	Compagnies aériennes	1,68 %
Énergie	Services de champ pétrolifère	1,50 %
Biens de consommation cyclique	Détaillants	1,36 %
Transports	Services de transport	1,06 %
Énergie	Raffinage	0,17 %
Énergie	Intégrée	0,12 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

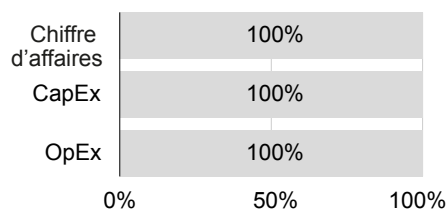
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

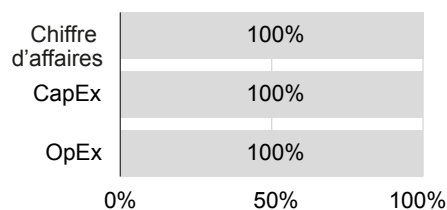
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global High Yield Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Global Long-Horizon Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300UI1W5KUOTB6B84

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

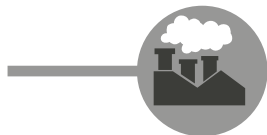
Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Microsoft Corp	Technologie de l'information	5,87 %	États-Unis
Boston Scientific Corp	Soins de santé	4,40 %	États-Unis
Intercontinental Exchange Inc	Finance	4,34 %	États-Unis
Mastercard Inc Class A	Finance	4,29 %	États-Unis
Otis Worldwide Corp	Produits industriels	4,27 %	États-Unis
American Express	Finance	4,19 %	États-Unis
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	4,09 %	États-Unis
Unitedhealth Group Inc	Soins de santé	4,08 %	États-Unis
Charles Schwab Corp	Finance	3,63 %	États-Unis
Amazon Com Inc	Produits accessoires	3,56 %	États-Unis
Applied Material Inc	Technologie de l'information	3,53 %	États-Unis
HDFC Bank Ltd	Finance	3,50 %	Inde
Symrise AG	Matières premières	3,46 %	Allemagne
EssilorLuxottica SA	Soins de santé	3,21 %	France
LVMH	Produits accessoires	3,06 %	France

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

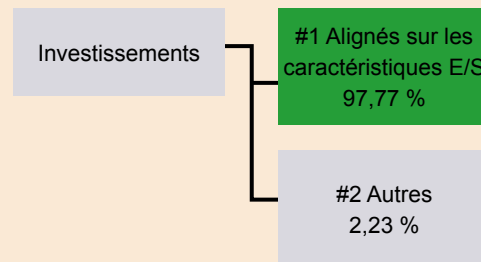
Global Long-Horizon Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Finance	Services financiers	18,72 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	14,67 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	11,01 %
Produits industriels	Biens d'équipement	9,19 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	8,96 %
Produits accessoires	Bien durables	4,82 %
Finance	Banques	3,96 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	3,56 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	3,53 %
Matières premières	Matières premières	3,46 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	3,00 %
Finance	Assurance	2,98 %
Communication	Médias et divertissement	2,66 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	2,34 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	2,20 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	1,85 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	1,61 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	1,54 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

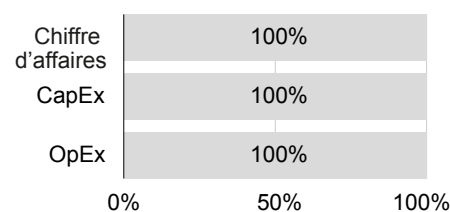
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

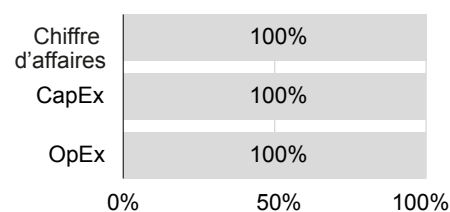
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Global Long-Horizon Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
Impact Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493000ECOD9JNFIPS55

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 73,40 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 22,75 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)



Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités positives

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Le Compartiment investit globalement au moins 80 % de ses actifs totaux dans des investissements « à impact » réalisés avec l'intention de générer un impact social et/ou environnemental positif et mesurable, en même temps qu'un rendement financier.

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	83,79 %
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	96,15 % ¹
Investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités positives	% d'investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds	98,62 %

¹ Pendant la période de référence, le Fonds a connu une violation active en raison de la détention d'un émetteur qui ne répondait pas aux critères pour être considéré comme un Investissement durable. La violation a été identifiée, signalée et corrigée dans le cadre du processus standard de résolution des violations de BlackRock.

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

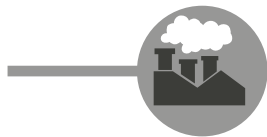
- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexactes ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Emissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)
Empreinte carbone
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
Rejets dans l'eau
Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales
Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales
Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
Mixité au sein des organes de gouvernance
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)
Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 6 octobre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Agence Francaise De Developpement Mtn Regs 2031-09-29	Gouvernemental	2,67 %	France
International Bank For Reconstruct Mtn 20/04/2028	Gouvernemental	2,36 %	Supranational
BLK Leaf Fund Agency Acc T0 Eur	Fonds mutuels	2,29 %	Irlande
Allemagne (République fédérale d') RegS 15/10/2027	Trésor	2,20 %	Allemagne
Gnma2 30Yr 20/05/2048	Securitized	1,61 %	États-Unis
European Union Regs 04/11/2050	Gouvernemental	1,53 %	Supranational
Canada (Gouvernement du) 01/12/2029	Trésor	1,52 %	Canada
European Union Regs 04/02/2048	Gouvernemental	1,31 %	Supranational
Corée (République de) 15/10/2026	Gouvernemental	1,23 %	Corée (du Sud), République de
Uk Conv Gilt Regs 31/07/2033	Trésor	1,18 %	Royaume-Uni
Belgique Royaume de (Gouvernement) 22/04/2039	Trésor	1,11 %	Belgique
European Union Regs 24/02/2043	Gouvernemental	1,11 %	Supranational
Societe Du Grand Paris Mtn Regs 25/05/2034	Gouvernemental	1,07 %	France
Credit Agricole Home Loan Sfh Regs 06/12/2029	Securitized	1,02 %	France
Unedic Mtn Regs 19/11/2030	Gouvernemental	1,00 %	France

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

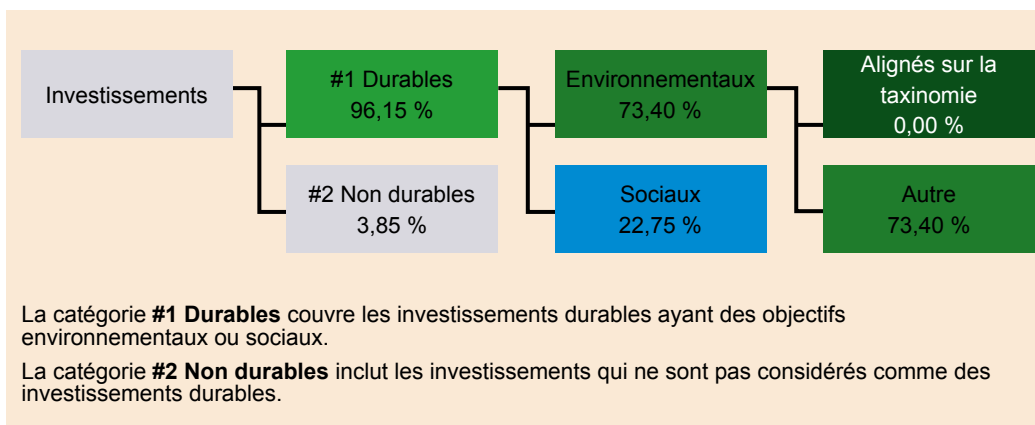
Impact Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Banques	Autre	18,10 %
Gouvernemental	Agence	16,80 %
Gouvernemental	Supranational	13,37 %
Trésor	Trésor	11,42 %
Électricité	Autre	7,33 %
Gouvernemental	Souverain	4,39 %
Gouvernemental	Autorités locales	4,30 %
Securitized	Couvert	4,13 %
Sociétés de financement	Autre	2,37 %
Securitized	MBS Pass-Through	2,11 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	1,33 %
SCPI	Autres REIT	1,30 %
Assurance	Assurance-vie	1,14 %
Autres services aux collectivités	Autre	1,05 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : intégrés, indépendants, midstream, services du secteur pétrolier, raffinage, métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

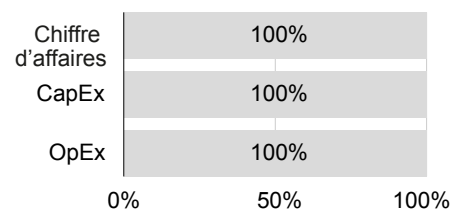
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

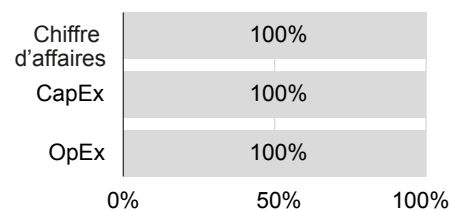
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 73,40 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 22,75 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités et des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et des agences du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prend dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Impact Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Multi-Theme Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300Q710S0IUIPBZ60

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 63,81 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif, ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG ou composés d'obligations émises par des gouvernements qui ont une notation souveraine ESG d'au moins BB (défini par des fournisseurs de données ESG tiers) et, dans les deux cas, sont des OPC dont le statut est conforme au Règlement SFDR

Maintien d'au moins 10 % des positions du Fonds dans des investissements qui soutiennent spécifiquement les objectifs climatiques

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif, ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG ou composés d'obligations émises par des gouvernements qui ont une notation souveraine ESG d'au moins BB (défini par des fournisseurs de données ESG tiers) et, dans les deux cas, sont des OPC dont le statut est conforme au Règlement SFDR	% de detentions d'organismes de placement collectif sous-jacents	87,89 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	63,81 %
Maintien d'au moins 10 % des positions du Fonds dans des investissements qui soutiennent spécifiquement les objectifs climatiques	% d'investissement dans des objectifs climatiques	33,60 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 63,81 % de ses detentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité
	Maintien d'au moins 10 % des positions du Fonds dans des investissements qui soutiennent spécifiquement les objectifs climatiques
Émissions de gaz à effet de serre (GES)	P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements	P

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 14 décembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BGF Sustainable Energy X2 Usd	Énergie	14,29 %	Luxembourg
BGF Circ Ec Fd X2 Usd	Fonds mutuels	13,58 %	Luxembourg
iShares Gbl Wter Etf \$ Dist	ETF	11,04 %	Irlande
iShares Digital Security Uci Usd_A	ETF	8,62 %	Irlande
iShares Agribusiness Ucits Etf	ETF	8,41 %	Irlande
iShares Auto & Rbot Etf Usd Acc	ETF	8,02 %	Irlande
iShares MSCI Em Cons Grth Etf \$ Acc	ETF	6,28 %	Irlande
iShares Gbl Infra Etf \$ Dist	ETF	5,63 %	Irlande
iShares Ageing Population Usd Acc	ETF	5,52 %	Irlande
BGF Nutrition Fund X2 Usd	Fonds mutuels	4,68 %	Luxembourg
BGF Fintech Fund X2 Usd	Fonds mutuels	3,99 %	Luxembourg
iShares Health Innov Etf Usd Acc	ETF	3,56 %	Irlande
iShares Elec Vehicles Drvng Etf Usd A	ETF	2,40 %	Irlande
iShares Global Clean Energy Ucits	ETF	1,75 %	Irlande
BGF Next Gen Tech Fd X2 Usd	Fonds mutuels	1,03 %	Luxembourg

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

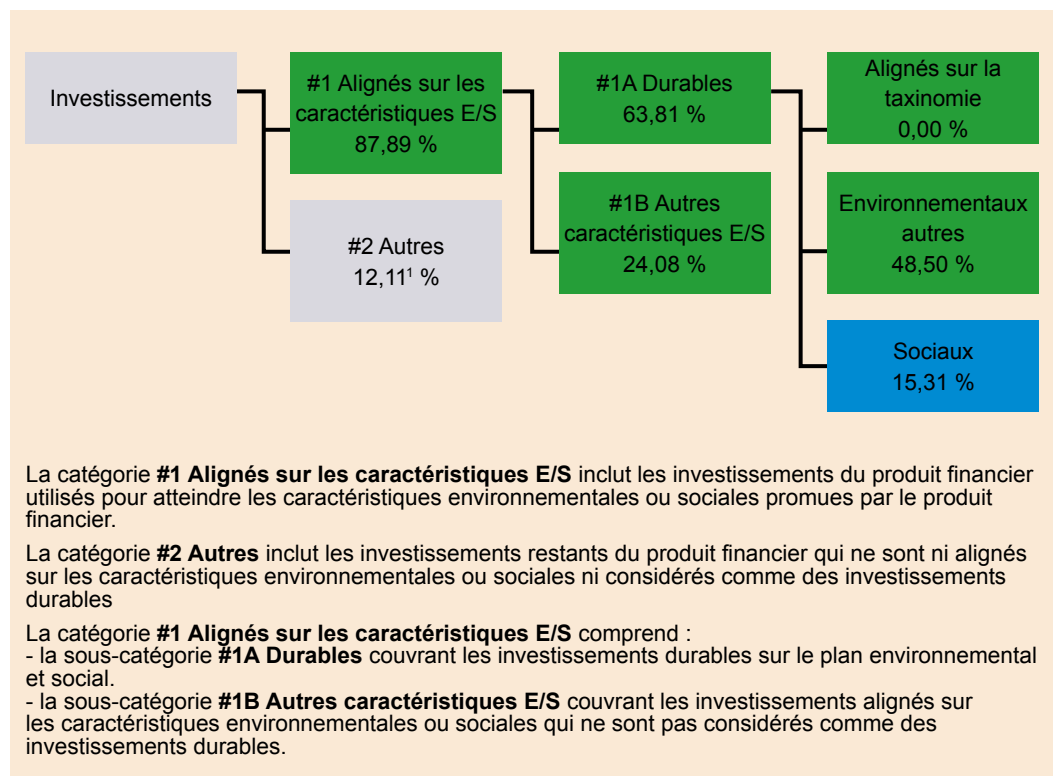
Multi-Theme Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



¹ L'exposition nette aux « Autres » actifs a été de -0,05 % en raison des positions dans des instruments dérivés détenues sur le Fonds.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	16,18 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	11,38 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	11,29 %
Matières premières	Matières premières	9,96 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	7,14 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	5,86 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	5,05 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	4,77 %
Finance	Services financiers	3,89 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	3,40 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	3,09 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,30 %
ETF	ETF	2,11 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	1,97 %
Finance	Assurance	1,44 %
Produits accessoires	Bien durables	1,13 %
Produits industriels	Transports	1,13 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	1,09 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	0,43 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,07 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,04 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,00 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	0,00 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : forage gazier et pétrolier, ou charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

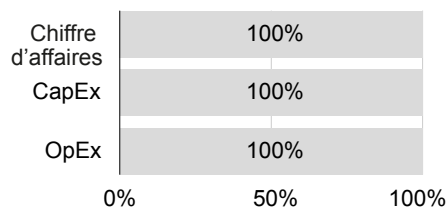
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

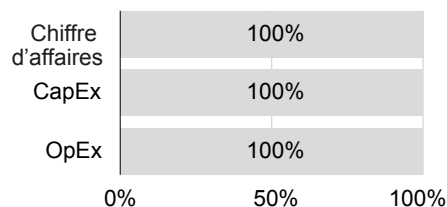
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 48,50 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 15,31 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Multi-Theme Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Next Generation Health Care Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493002ZMKARYN5J9X36

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice MSCI All Countries World Index (l'« Indice »)

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à l'indice MSCI All Countries World Index	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-18,20 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	4,44 %	Irlande
Vertex Pharmaceuticals Inc	Soins de santé	2,78 %	États-Unis
Alcon Ag	Soins de santé	2,76 %	Suisse
Boston Scientific Corp	Soins de santé	2,53 %	États-Unis
Intuitive Surgical Inc	Soins de santé	2,46 %	États-Unis
Cencora, Inc.	Soins de santé	2,33 %	États-Unis
West Pharmaceutical Services Inc	Soins de santé	2,06 %	États-Unis
Mettler Toledo Inc	Soins de santé	1,92 %	États-Unis
Cooper Inc	Soins de santé	1,87 %	États-Unis
Gilead Sciences Inc	Soins de santé	1,83 %	États-Unis
Stryker Corp	Soins de santé	1,78 %	États-Unis
Penumbra Inc	Soins de santé	1,73 %	États-Unis
Dexcom Inc	Soins de santé	1,66 %	États-Unis
Alnylam Pharmaceuticals Inc	Soins de santé	1,66 %	États-Unis
Argenx Se Adr	Soins de santé	1,60 %	Pays-Bas

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

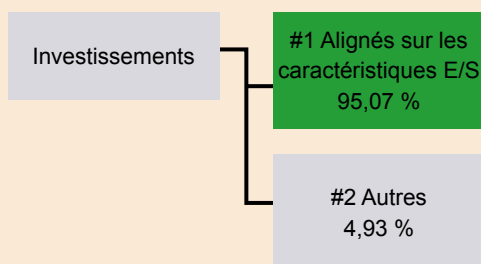
Next Generation Health Care Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	58,81 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	36,00 %
Finance	Services financiers	4,44 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

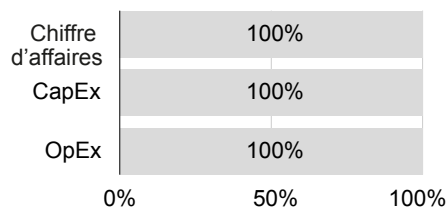
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

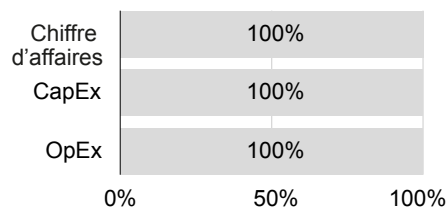
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental** au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Next Generation Health Care Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Next Generation Technology Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300WSSL4Z83Z2VF84

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

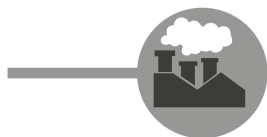
Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Synopsys Inc	Technologie de l'information	3,80 %	États-Unis
Nvidia Corp	Technologie de l'information	3,58 %	États-Unis
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Finance	2,76 %	Irlande
ASM International NV	Technologie de l'information	2,69 %	Pays-Bas
Tesla Inc	Produits accessoires	2,66 %	États-Unis
Lattice Semiconductor Corp	Technologie de l'information	2,57 %	États-Unis
On Semiconductor Corp	Technologie de l'information	2,34 %	États-Unis
Informa Plc	Communication	2,16 %	Royaume-Uni
Samsung Sdi Ltd	Technologie de l'information	2,11 %	Corée (du Sud), République de
Monolithic Power Systems Inc	Technologie de l'information	2,10 %	États-Unis
Pure Storage Inc Class A	Technologie de l'information	2,00 %	États-Unis
Jabil Inc	Technologie de l'information	1,95 %	États-Unis
Soitec Sa	Technologie de l'information	1,88 %	France
Altium Ltd	Technologie de l'information	1,87 %	Australie
Wolfspeed Inc	Technologie de l'information	1,78 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

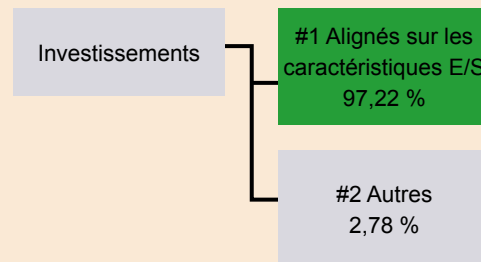
Next Generation Technology Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	33,38 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	24,39 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	11,65 %
Communication	Médias et divertissement	8,39 %
Finance	Services financiers	7,10 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	3,11 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	2,83 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	2,73 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,66 %
Produits industriels	Biens d'équipement	2,08 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

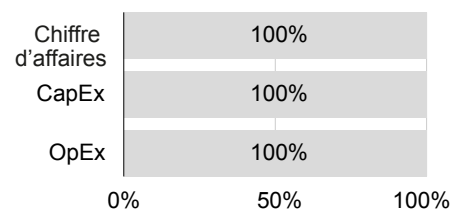
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

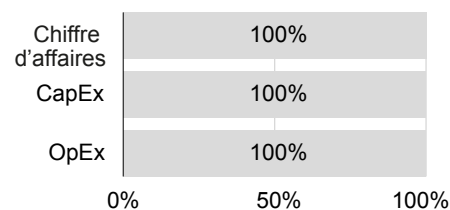
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Next Generation Technology Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dénomination du produit :
Nutrition Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300JF9YVE3CKHH246

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 46,50 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 43,47 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'Investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'Investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

La note ESG moyenne pondérée du Compartiment sera plus élevée que la note ESG du Factset Nutrition Universe après l'élimination d'au moins 20 % des titres les moins bien notés du Factset Nutrition Universe. Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
La note ESG moyenne pondérée du Compartiment sera plus élevée que la note ESG du Factset Nutrition Universe après l'élimination d'au moins 20 % des titres les moins bien notés du Factset Nutrition Universe.	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	89,97 %
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexacts ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Émissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)

Empreinte carbone

Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements

Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles

Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable

Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique

Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité

Rejets dans l'eau

Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs

Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales

Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales

Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé

Mixité au sein des organes de gouvernance

Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)

Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)

Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BLK ICS USD Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	5,32 %	Irlande
Zoetis Inc Class A	Soins de santé	4,00 %	États-Unis
Nestlé SA	Produits de consommation courante	3,96 %	Suisse
Kerry Group Plc	Produits de consommation courante	3,91 %	Irlande
Barry Callebaut AG	Produits de consommation courante	3,87 %	Suisse
Graphic Packaging Holding	Matières premières	3,87 %	États-Unis
FMC Corp	Matières premières	3,83 %	États-Unis
Bunge Ltd	Produits de consommation courante	3,69 %	États-Unis
Deere	Produits industriels	3,64 %	États-Unis
Salmar	Produits de consommation courante	3,60 %	Norvège
China Mengniu Dairy Ltd	Produits de consommation courante	3,60 %	Hong Kong
John Bean Technologies Corp	Produits industriels	3,45 %	États-Unis
Grocery Outlet Holding Corp	Produits de consommation courante	3,41 %	États-Unis
Archer Daniels Midland	Produits de consommation courante	3,38 %	États-Unis
Agco Corp	Produits industriels	3,07 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

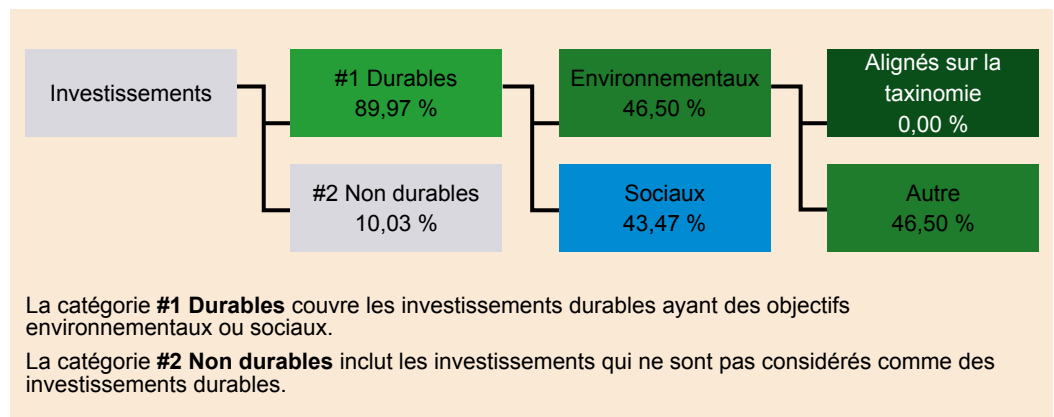
Nutrition Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	34,59 %
Matières premières	Matières premières	25,16 %
Produits industriels	Biens d'équipement	14,72 %
Finance	Services financiers	7,26 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	6,00 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	4,50 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	2,91 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	2,27 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

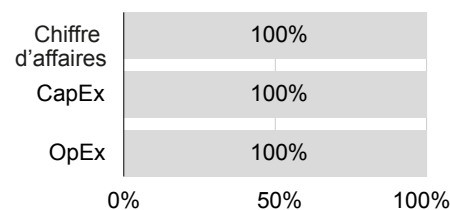
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

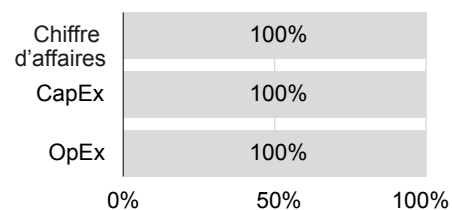
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables** sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 46,50 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 43,47 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Nutrition Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable Asian Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300JZ0LV6GHH1FT27

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 30,83 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice J.P.

Morgan Asia Credit Index (l'« Indice ») après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice de Reporting ESG

Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à l'indice J.P. Morgan Asia Credit Index de 30 %

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Exclusion des émetteurs qui, de l'avis du Gestionnaire financier par délégation, (i) tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution d'huile de palme, (ii) tirent plus de 5 % de leurs revenus de la propriété ou de l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard, ou (iii) sont impliqués dans la production de supports de divertissement pour adultes

Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 % Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	30,83 %
Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %	Réduction de l'univers d'investissement	La politique ESG a réduit l'univers d'investissement de plus de 20 % sur la période de référence
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice J.P. Morgan Asia Credit Index après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice de Reporting ESG.	Notation ESG du Fonds	La note ESG moyenne pondérée du Fonds était supérieure à celle de l'indice sur toute la période de référence
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice J.P. Morgan Asia Credit Index de 30 %	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-70,42 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	23,82 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 30,83 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- (iv) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	3,01 %	Irlande
Icbcil Finance Co Ltd Mtn Regs 02/11/2026	Gouvernemental	1,04 %	Hong Kong
BGF China Onshore Bnd Fd X2 Us H	Fonds	0,98 %	Luxembourg
BGF China Onshore Bnd Fd X2 Cnh	Fonds	0,97 %	Luxembourg
Rural Electrification Corp Ltd Mtn Regs 07/07/2027	Gouvernemental	0,97 %	Inde
Standard Chartered Plc Regs 01/04/2031	Banques	0,81 %	Royaume-Uni
Minor International Pcl Regs 31/12/2079	Biens de consommation cyclique	0,75 %	Thaïlande
Sarana Multi Infrastruktur (Perser Mtn Regs 11/05/2026	Gouvernemental	0,72 %	Indonésie
Oversea-Chinese Banking Corporatio Regs 10/09/2030	Banques	0,69 %	Singapour
Indonésie (République d') 11/01/2033	Gouvernemental	0,63 %	Indonésie
Kasikornbank Pcl (Hong Kong Branch Mtn Regs 02/10/2031	Banques	0,62 %	Hong Kong
Network I2I Ltd Regs 31/12/2079	Communications	0,61 %	Maurice
Perusahaan Penerbit Surat Berharga Regs 09/06/2051	Gouvernemental	0,61 %	Indonésie
Tsmc Global Ltd Regs 28/09/2030	Technologie	0,61 %	Îles Vierges britanniques
Standard Chartered Plc Regs 09/01/2029	Banques	0,59 %	Royaume-Uni

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

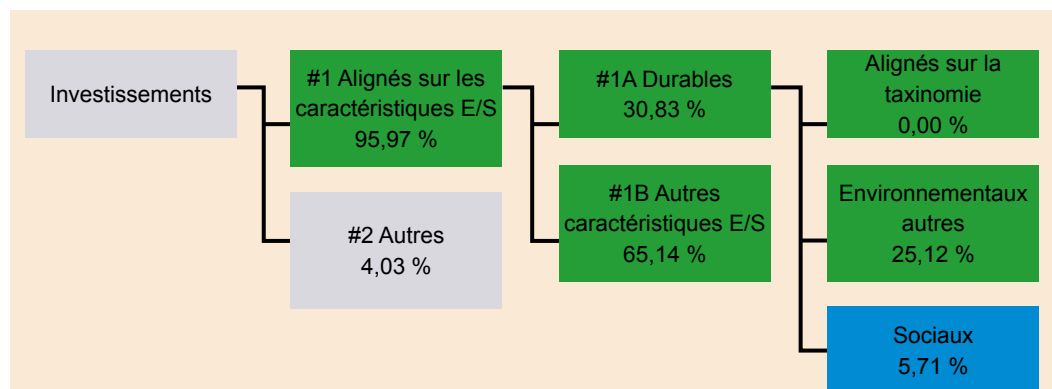
Sustainable Asian Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Gouvernemental	Agence	27,09 %
Banques	Autre	16,35 %
Gouvernemental	Souverain	9,21 %
Sociétés de financement	Autre	5,45 %
Autres secteurs financiers	Autre	5,18 %
Technologie	Autre	5,03 %
Autres industries	Autre	2,95 %
Électricité	Autre	2,78 %
Gouvernemental	Autorités locales	2,57 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	2,16 %
Trésor	Trésor	2,13 %
Fonds	Autre	1,95 %
Communications	Câbles électriques	1,60 %
Transports	Services de transport	1,59 %
Communications	Wireless	1,57 %
Assurance vie	Assurance	1,46 %
Énergie	Raffinage	1,32 %
Biens de consommation cyclique	Restaurants	1,29 %
Biens de consommation cyclique	Construction individuelle	1,28 %
Énergie	Midstream	1,08 %
Énergie	Intégrée	1,06 %
Énergie	Indépendante	0,56 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : services de champ pétrolifère, métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

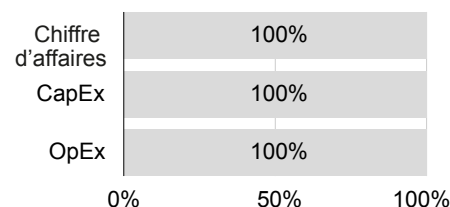
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

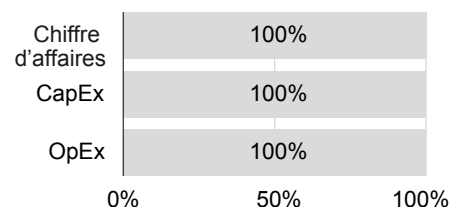
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 25,12 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 5,71 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » peuvent comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Asian Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300QOEVAPNM75H450

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 25,98 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'indice JP Morgan Emerging Markets Bond Index (l'« Indice »).

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

S'assurer qu'au moins 70 % du total de l'actif du Fonds sont investis dans des titres de l'indice J.P. Morgan

Blended Emerging Market Bond Index

Investissement dans des Investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice JP Morgan Emerging Markets Bond Index	Investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds par rapport à l'Indice de Reporting ESG	22,66 % supérieur à l'Indice
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	25,98 %
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	7,97 %
S'assurer qu'au moins 70 % du total de l'actif du Fonds sont investis dans des titres du J.P. Morgan Blended Emerging Market Bond Index	% d'investissements dans l'Indice	87,41 %
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 25,98 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respectés les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice de Reporting ESG	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique					P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bon de trésorerie 30/04/2024	Trésor	2,64 %	États-Unis
Mexique (États-Unis mexicains) (23/11/2034)	Trésor	2,46 %	Mexique
Brésil (République Fédérale du) 01/01/2025	Trésor	2,12 %	Brésil
Indonésie (République d') 15/03/2034	Trésor	1,69 %	Indonésie
Afrique du Sud (République d') 21/12/2026	Trésor	1,64 %	Afrique du Sud
Brésil (République Fédérale du) (01/01/2027)	Trésor	1,63 %	Brésil
Mexique (États-Unis mexicains) (07/12/2023)	Trésor	1,56 %	Mexique
Malaisie (Gouvernement) 05/07/2034	Trésor	1,46 %	Malaisie
Hongrie (République de) 24/11/2023	Trésor	1,39 %	Hongrie
Chili (République du) 2026-03-01	Trésor	1,34 %	Chili
Bon de trésorerie 31/12/2022	Trésor	1,29 %	États-Unis
Bon du Trésor 24/11/2023	Trésor	1,27 %	États-Unis
Mexique (États-Unis mexicains) (29/05/2031)	Trésor	1,21 %	Mexique
Hongrie (Gouvernement) Regs 22/02/2027	Gouvernemental	1,19 %	Hongrie
Qatar (État du) Regs 16/04/2050	Gouvernemental	1,17 %	Qatar

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

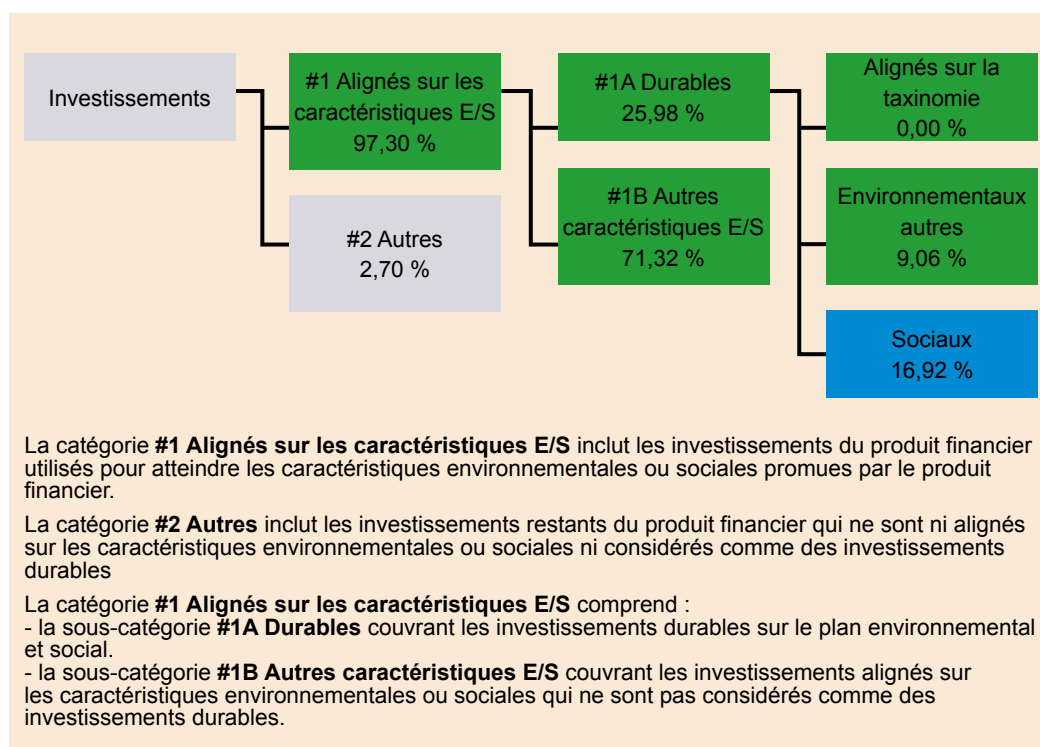
Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Trésor	Trésor	54,73 %
Gouvernemental	Souverain	39,76 %
Gouvernemental	Agence	1,04 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : intégrés, indépendants, midstream, services du secteur pétrolier, raffinage, métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

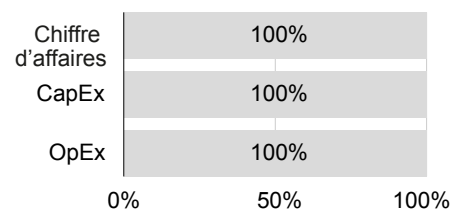
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

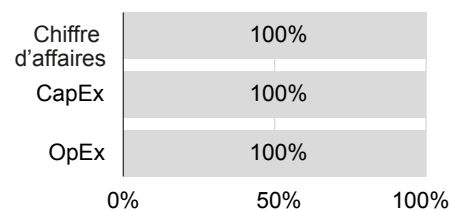
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 9,06 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

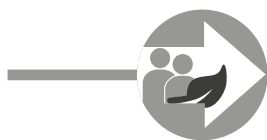
Pour la période de référence, 16,92 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Blended Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable Emerging Markets Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300EJQVU7N2R7YO52

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 24,79 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

S'assurer qu'au moins 70 % du total de l'actif du Fonds est investi dans des titres du J.P. Morgan ESG Emerging Market Bond Index Global Diversified Index (l'« Indice »)

Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	24,79 %
Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice	Investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds par rapport à l'Indice de Reporting ESG	30,96 % supérieur à l'Indice
S'assurer qu'au moins 70 % du total de l'actif du Fonds est investi dans des titres du J.P. Morgan ESG Emerging Market Bond Index Global Diversified Index	% d'investissements dans l'Indice	88,39 %
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	12,45 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 24,79 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

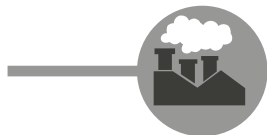
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice de Reporting ESG	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique					P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Pérou (République du) 15/01/2034	Gouvernemental	1,39 %	Pérou
Sharjah Sukuk Programme Ltd Regs 23/10/2029	Gouvernemental	1,20 %	Îles Caïmans
Sultanat d'Oman (gouvernement) Regs 08/03/2047	Gouvernemental	1,17 %	Oman
Chili (République du) 2032-01-27	Gouvernemental	1,14 %	Chili
Qatar (État du) Regs 14/03/2049	Gouvernemental	1,13 %	Qatar
Mexique (États-Unis mexicains) (12/08/2036)	Gouvernemental	1,10 %	Mexique
République du Panama (Gouvernement) 17/03/2028	Gouvernemental	1,08 %	Panama
Chili (République du) 2033-07-27	Gouvernemental	0,97 %	Chili
Bahreïn (Royaume du) 20/09/2029	Gouvernemental	0,96 %	Bahreïn
République du Panama (Gouvernement) 23/01/2030	Gouvernemental	0,95 %	Panama
Hongrie (République de) Regs 22/09/2031	Gouvernemental	0,95 %	Hongrie
Argentine (République de) (Gouvernement) 09/07/2035	Gouvernemental	0,94 %	Argentine
Colombie (République de) (Gouvernement) 26/02/2044	Gouvernemental	0,93 %	Colombie
Équateur (République de) (Gouvernement) Regs 31/07/2035	Gouvernemental	0,93 %	Équateur
Gaci First Investment Co Mtn Regs 2027-10-13	Gouvernemental	0,91 %	Îles Caïmans

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

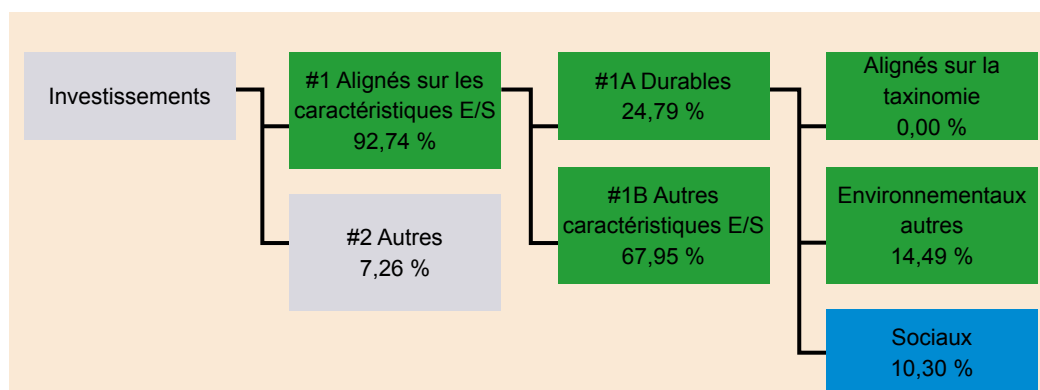
Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Gouvernemental	Souverain	83,73 %
Gouvernemental	Agence	6,49 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : intégrés, indépendants, midstream, services du secteur pétrolier, raffinage, métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

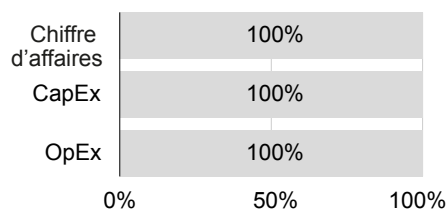
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

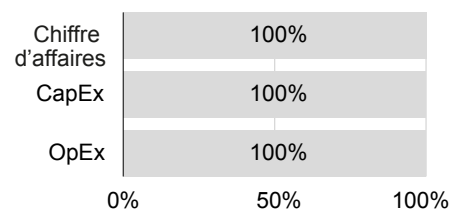
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 14,49 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 10,30 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300RP1XQIVCL46L82

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 31,84 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

S'assurer qu'au moins 70 % du total de l'actif du Fonds sont investis dans des titres du J.P. Morgan ESG Corporate Emerging Market Bond Index Broad Diversified Index (l'« Indice »)

Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détentions du Fonds) par rapport au J.P. Morgan Corporate Emerging Market Bond Index Broad Diversified de 30 %

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice	Investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds par rapport à l'Indice	25,50 % supérieur à l'Indice
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	14,58 %
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à l'Indice de 30 %	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-39,38 %
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
S'assurer qu'au moins 70 % du total de l'actif du Fonds sont investis dans des titres du J.P. Morgan ESG Corporate Emerging Market Bond Index Broad Diversified Index	% d'investissements dans l'Indice	88,34 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	31,84 %
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 31,84 % de ses détections dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- (iv) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

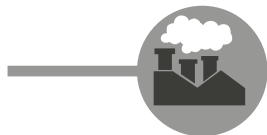
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice de Reporting ESG	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique					P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Aes Panama Generation Holdings Srl Regs 31/05/2030	Électricité	1,58 %	Panama
Bbva Bancomer Sa Institucion De Ba Regs 13/09/2034	Banques	1,57 %	États-Unis
Inretail Consumer Regs 22/03/2028	Biens de consommation non cyclique	1,56 %	Pérou
Corporacion Inmobiliaria Vesta Sab Regs 13/05/2031	Autres secteurs financiers	1,55 %	Mexique
Turkiye Sise Ve Cam Fabrikalari As Regs 14/03/2026	Biens d'équipement	1,52 %	Turquie
Anglogold Ashanti Holdings Plc 01/11/2028	Industrie de base	1,47 %	Île de Man
Mercadolibre Inc 14/01/2031	Biens de consommation cyclique	1,46 %	États-Unis
Cemex Sab De Cv Registres 31/12/2079	Biens d'équipement	1,44 %	Mexique
Cap Sa Regs 27/04/2031	Industrie de base	1,40 %	Chili
Minsur Sa Regs 28/10/2031	Industrie de base	1,39 %	Pérou
Prosus Nv Mtn Regs 13/07/2031	Communications	1,39 %	Pays-Bas
Greenko Power Ii Limited Regs 13/12/2028	Gouvernemental	1,39 %	Maurice
Abu Dhabi Commercial Bank Pjsc Mtn Regs 14/09/2027	Gouvernemental	1,37 %	Émirats arabes unis
Star Energy Geothermal Darajat Ii Regs 2038-10-14	Électricité	1,36 %	Bermudes
Aldar Sukuk No 2 Ltd Regs 22/10/2029	Autres secteurs financiers	1,36 %	Îles Caïmans

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

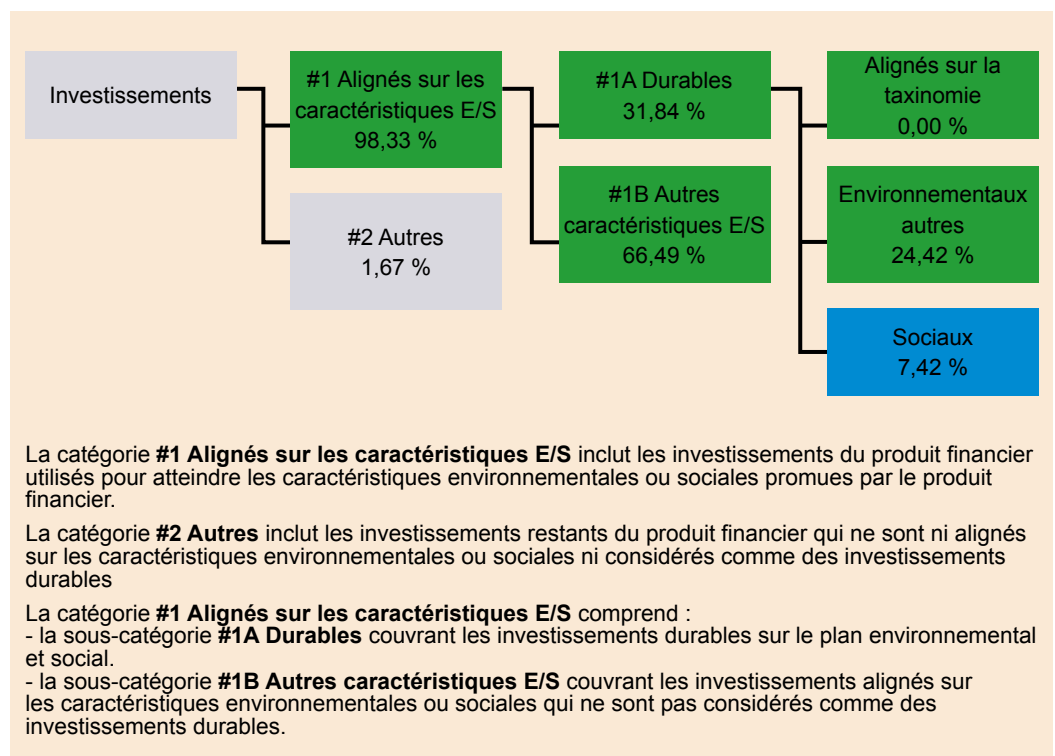
Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Gouvernemental	Agence	21,87 %
Banques	Autre	10,67 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	10,34 %
Autres secteurs financiers	Autre	6,41 %
Électricité	Autre	6,23 %
Communications	Wireless	5,55 %
Biens de consommation non cyclique	Alimentation et boissons	5,23 %
Énergie	Indépendante	3,00 %
Industrie de base	Papier	2,51 %
Industrie de base	Produits chimiques	2,51 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	2,15 %
SCPI	Autres REIT	2,05 %
Trésor	Trésor	1,96 %
Communications	Médias et divertissement	1,81 %
Biens de consommation non cyclique	Supermarchés	1,56 %
Biens d'équipement	Matériaux de construction	1,56 %
Biens d'équipement	Manufacture diversifiée	1,52 %
Technologie	Autre	1,50 %
Biens de consommation cyclique	Détaillants	1,46 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	1,37 %
Communications	Câble et satellite	1,29 %
Autres industries	Autre	1,22 %
Biens de consommation cyclique	Restaurants	1,10 %
Énergie	Raffinage	0,59 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (tels que définis par le Barclays Industry Classification System) : intégrés, midstream, services du secteur pétrolier.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

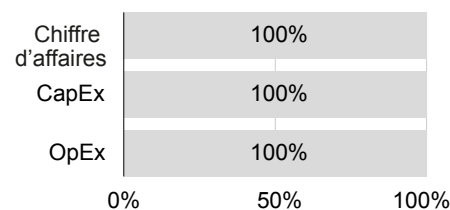
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

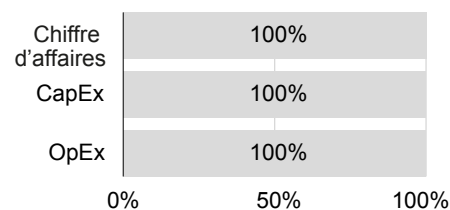
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 24,42 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 7,42 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300T218NWJ8CPIT42

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 28,31 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

S'assurer qu'au moins 70 % du total de l'actif du Fonds est investi dans des titres du J.P. Morgan ESG Government Bond Index – Emerging Market Global Diversified Index (l'« Indice »)

Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
S'assurer qu'au moins 70 % du total de l'actif du Fonds est investi dans des titres du J.P. Morgan ESG Government Bond Index – Emerging Market Global Diversified Index	% d'investissements dans l'Indice	95,15 %
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	5,39 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	28,31 %
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice	Investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds par rapport à l'Indice	20,70 % supérieur à l'Indice

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 28,31 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

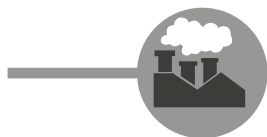
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice de Reporting ESG	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique					P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Colombie (République de) 26/03/2031	Trésor	2,78 %	Colombie
Brésil (République Fédérale du) (01/01/2029)	Trésor	2,32 %	Brésil
Afrique du Sud (République d') 28/02/2031	Trésor	2,06 %	Afrique du Sud
Brésil (République Fédérale du) (01/01/2027)	Trésor	1,94 %	Brésil
République tchèque Regs 25/10/2023	Trésor	1,89 %	République tchèque
Mexique (États-Unis mexicains) (29/05/2031)	Trésor	1,67 %	Mexique
Brésil (République Fédérale du) (01/01/2031)	Trésor	1,51 %	Brésil
Afrique du Sud (République d') 21/12/2026	Trésor	1,48 %	Afrique du Sud
Afrique du Sud (République d') 31/01/2030	Trésor	1,45 %	Afrique du Sud
Brésil (République Fédérale du) (01/01/2026)	Trésor	1,39 %	Brésil
Mexique (États-Unis mexicains) (03/06/2027)	Trésor	1,38 %	Mexique
Pérou (République du) Regs 12/08/2031	Trésor	1,37 %	Pérou
République tchèque Regs 25/05/2024	Trésor	1,34 %	République tchèque
Pologne (République de) 25/10/2029	Trésor	1,31 %	Pologne
Mexique (États-Unis mexicains) (05/03/2026)	Trésor	1,30 %	Mexique

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

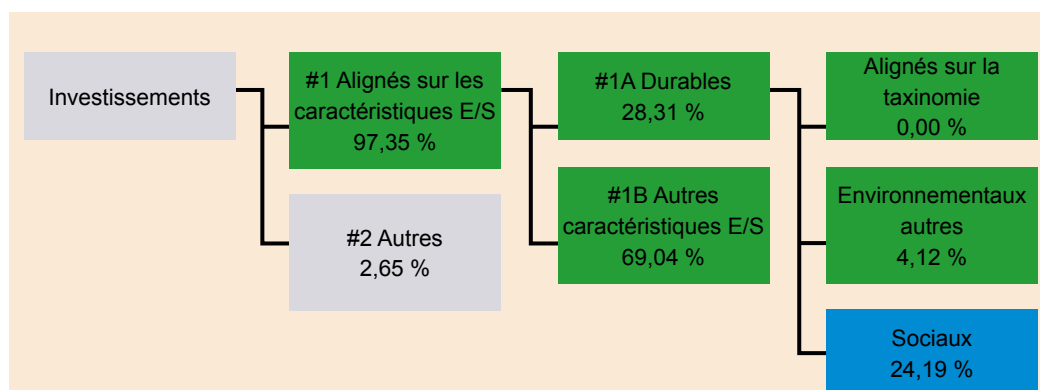
Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Trésor	Trésor	93,48 %
Gouvernemental	Souverain	3,84 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : intégrés, indépendants, midstream, services du secteur pétrolier, raffinage, métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

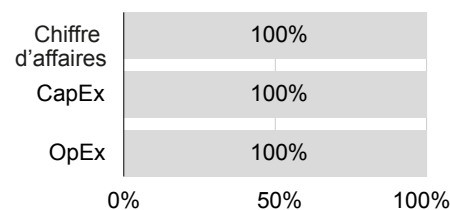
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

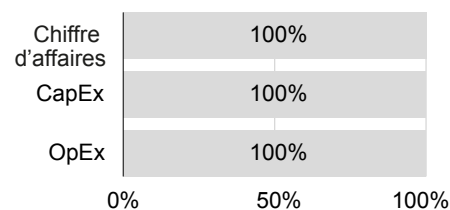
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 4,12 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 24,19 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Emerging Markets Local Currency Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dénomination du produit :
Sustainable Energy Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493009Z1H3ONBJRQ80

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 86,52 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 5,75 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'Investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'Investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI All Countries World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice Exclusion de l'investissement dans des sociétés qui sont classées dans les secteurs suivants (tels que définis selon la classification Global Industry Classification Standard) : charbon et consommables, exploration/production pétrolière et gazière, pétrole et gaz intégrés, tabac

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI All Countries World après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Exclusion de l'investissement dans des sociétés qui sont classées dans les secteurs suivants (tels que définis selon la classification Global Industry Classification Standard) : charbon et consommables, exploration/production pétrolière et gazière, pétrole et gaz intégrés, tabac	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	92,27 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexacts ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Émissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)
Empreinte carbone
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
Rejets dans l'eau
Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales
Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales
Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
Mixité au sein des organes de gouvernance
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)
Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
NextEra Energy Inc	Services aux collectivités	5,94 %	États-Unis
Rwe Ag	Services aux collectivités	5,26 %	Allemagne
Enel	Services aux collectivités	5,19 %	Italie
BLK ICS USD Leaf Agency Dist	Fonds mutuels	4,48 %	Irlande
EDP Energias De Portugal Sa	Services aux collectivités	3,27 %	Portugal
Samsung Sdi Ltd	Technologie de l'information	3,12 %	Corée (du Sud), République de
LG Chem Ltd	Matières premières	3,04 %	Corée (du Sud), République de
Analog Devices Inc	Technologie de l'information	2,97 %	États-Unis
Air Liquide Société Anonyme	Matières premières	2,88 %	France
Vestas Wind Systems	Produits industriels	2,87 %	Danemark
Infineon Technologies AG	Technologie de l'information	2,77 %	Allemagne
Ingersoll Rand Inc	Produits industriels	2,50 %	États-Unis
Stmicroelectronics Nv	Technologie de l'information	2,42 %	Suisse
Schneider Electric	Produits industriels	2,38 %	France
Ansys Inc	Technologie de l'information	2,29 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

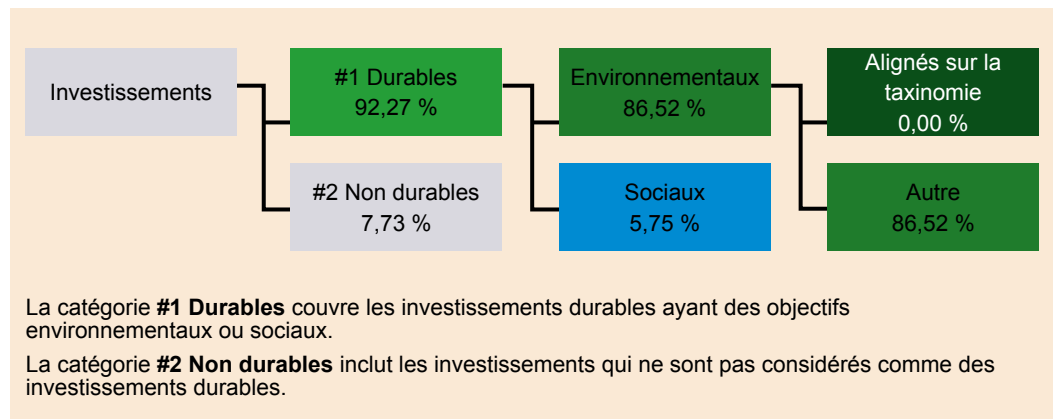
Sustainable Energy Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	25,52 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	24,87 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	16,74 %
Matières premières	Matières premières	11,99 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	7,98 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	4,94 %
Finance	Services financiers	4,48 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	1,95 %
Produits industriels	Transports	1,07 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

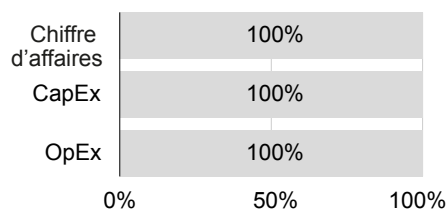
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

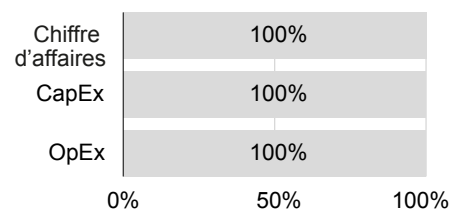
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables** sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 86,52 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 5,75 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « non durables » comprenaient des instruments dérivés, des instruments de liquidités et de quasi-liquidités et des actions ou parts d'OPC et de titres négociables à revenu fixe (également appelés titres de créance) émis par des organismes du monde entier, sans que ces détentions excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prend dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Energy Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300WDFK3XK5N3KS37

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 22,73 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités positives

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	22,73 %
Investissement dans des émetteurs réputés avoir des externalités positives	% d'investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds	30,30 %
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	10,54 %
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	2 ¹

¹ Pendant la période de référence, le Fonds a connu deux violations actives dues à la détention d'émetteurs qui tiraient plus de 5 % de leurs revenus de la production d'électricité à base de charbon thermique. Les violations ont été identifiées, signalées et corrigées dans le cadre du processus standard de résolution des violations de BlackRock.

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 22,73 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- (iv) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

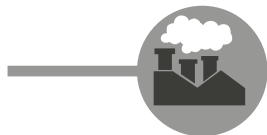
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités positives	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique					P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 13/07/2023	Securitized	2,19 %	États-Unis
Gnma2 30Yr 20/07/2050	Securitized	1,91 %	États-Unis
Bon de trésorerie (2Old) 15/02/2033	Trésor	1,82 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 14/09/2023	Securitized	1,76 %	États-Unis
Bon de trésorerie (Cpi) 15/01/2024	Trésor	1,54 %	États-Unis
Bon de trésorerie (Cpi) 15/04/2024	Trésor	1,54 %	États-Unis
Bon du Trésor 15/08/2052	Trésor	1,47 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 12/01/2023	Securitized	1,43 %	États-Unis
Espagne (Royaume d') 31/10/2032	Trésor	1,40 %	Espagne
Bon du Trésor 15/05/2052	Trésor	1,15 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 13/03/2023	Securitized	0,97 %	États-Unis
Espagne (Royaume d') 30/04/2033	Trésor	0,91 %	Espagne
Cash Collateral Usd Mlft 31/12/2049	Courtage/Gestionnaires d'actifs/Échanges	0,88 %	États-Unis
Bon de trésorerie 15/04/2026	Trésor	0,88 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 14/09/2023	Securitized	0,88 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

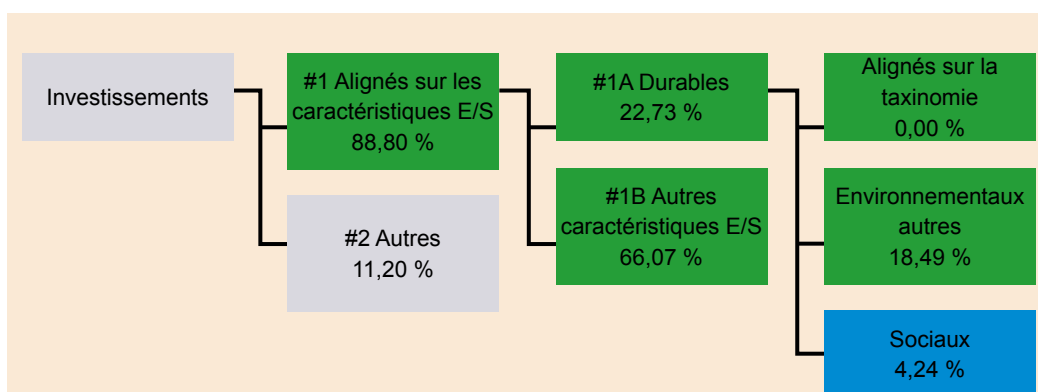
Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Trésor	Trésor	19,60 %
Securitized	MBS Pass-Through	10,73 %
Securitized	ABS	10,62 %
Banques	Autre	9,45 %
Securitized	CMBS	3,78 %
Technologie	Autre	2,94 %
Securitized	CMO	2,46 %
Communications	Câbles électriques	2,12 %
Courtage/Gestionnaires d'actifs/Échanges	Autre	2,04 %
Électricité	Autre	1,97 %
Communications	Wireless	1,70 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	1,50 %
Gouvernemental	Souverain	1,39 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	1,34 %
Biens de consommation non cyclique	Soins de santé	1,30 %
Gouvernemental	Agence	1,16 %
Gouvernemental	Autorités locales	1,14 %
Autres secteurs financiers	Autre	1,13 %
Énergie	Intégrée	0,55 %
Énergie	Raffinage	0,29 %
Énergie	Indépendante	0,28 %
Énergie	Midstream	0,21 %
Énergie	Services de champ pétrolifère	0,01 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

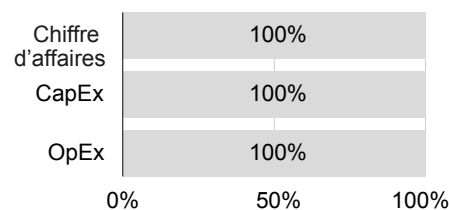
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

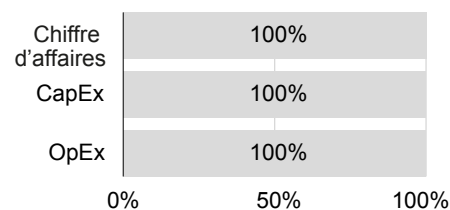
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 18,49 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 4,24 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Fixed Income Global Opportunities Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable Global Allocation Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300TYWZPHTEVJ5C72

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 35,14 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport au MSCI All Country World Index (60 %) et au Bloomberg Global Aggregate Index (40 %) (l'« Indice »)

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détections du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index (60 %) et au Bloomberg Global Aggregate Index (40 %)

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %	Réduction de l'univers d'investissement	La politique ESG a réduit l'univers d'investissement de plus de 20 % sur la période de référence
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	0,82 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	35,14 %
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice	Investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds par rapport à l'Indice	28,03 % supérieur à l'Indice
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million \$ de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à l'Indice	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-35,97 %
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 35,14 % de ses détections dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- (iv) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice de Reporting ESG	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique					P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 4 octobre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Umbs 30Yr Tba (Reg A)	Titres gouvernementaux	4,31 %	États-Unis
Microsoft Corp	Technologie de l'information	2,09 %	États-Unis
SAP	Technologie de l'information	1,89 %	Allemagne
Archer Daniels Midland	Produits de consommation courante	1,86 %	États-Unis
Mastercard Inc Class A	Finance	1,70 %	États-Unis
Eli Lilly	Soins de santé	1,51 %	États-Unis
Marsh & McLennan Inc	Finance	1,31 %	États-Unis
Astrazeneca Plc	Soins de santé	1,27 %	Royaume-Uni
Bon du Trésor	Titres espèces	1,22 %	États-Unis
Humana Inc	Soins de santé	1,19 %	États-Unis
Abbott Laboratories	Soins de santé	1,17 %	États-Unis
Nestlé SA	Produits de consommation courante	1,15 %	Suisse
ASML Holding NV	Technologie de l'information	1,11 %	Pays-Bas
Apple Inc	Technologie de l'information	1,11 %	États-Unis
American Tower Reit Corp	Immobilier	1,11 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

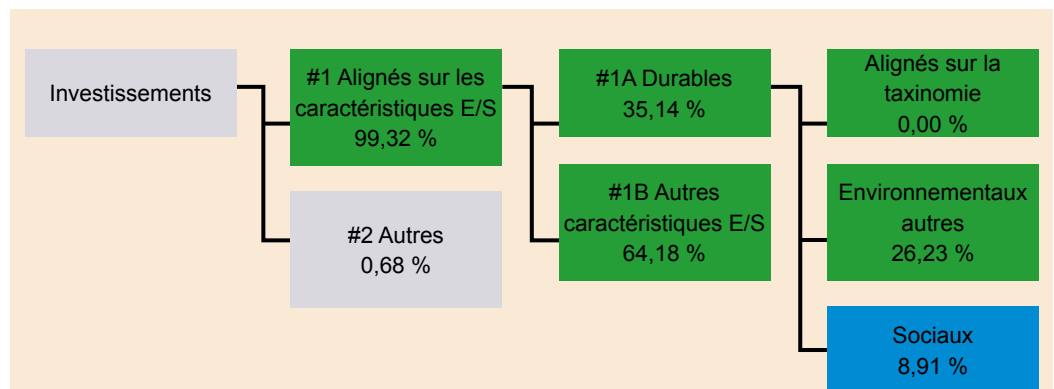
Sustainable Global Allocation Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	7,98 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	7,39 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	6,76 %
Produits industriels	Biens d'équipement	5,63 %
Titres gouvernementaux	Titres gouvernementaux	5,22 %
Finance	Services financiers	4,84 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	4,29 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	3,48 %
Finance	Banques	3,11 %
Matières premières	Matières premières	2,99 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,56 %
Finance	Assurance	2,24 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	2,14 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	1,70 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	1,66 %
Communication	Médias et divertissement	1,59 %
Communication	Télécommunications	1,33 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	1,23 %
Produits accessoires	Bien durables	0,98 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	0,97 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,62 %
Énergie	Charbon et combustibles	0,19 %
Énergie	Services d'équipement pétrolier et gazier	0,00 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	0,00 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : pétrole et gaz intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

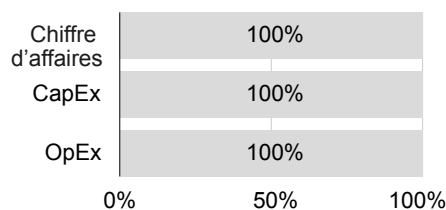
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

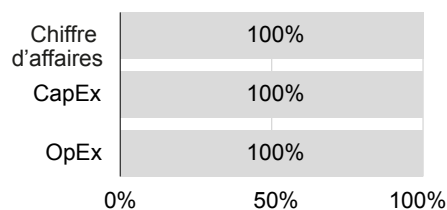
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 26,23 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 8,91 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Allocation Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable Global Bond Income Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300ZEXZCUT4KV2424

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 24,32 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités positives

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	24,32 %
Investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités positives	% d'investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds	48,07 %
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	8,55 %
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 24,32 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- (iv) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

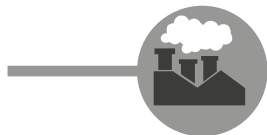
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités positives	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique						P
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 12/01/2023	Securitized	1,65 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 14/09/2023	Securitized	1,47 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 13/03/2023	Securitized	1,45 %	États-Unis
Fnma 30Yr Umbs Super 01/05/2050	Securitized	1,30 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 13/06/2023	Securitized	0,81 %	États-Unis
Cash Collateral Usd Hsbft 31/12/2049	Banques	0,80 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba 14/09/2023	Securitized	0,79 %	États-Unis
Bon du Trésor 16/11/2023	Trésor	0,75 %	États-Unis
Cifc_17-1A B 144A 23/04/2029	Securitized	0,71 %	Îles Caïmans
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 13/03/2023	Securitized	0,69 %	États-Unis
Ncms_18-Sox E 144A 17/06/2038	Securitized	0,61 %	États-Unis
Cifc_14-2Ra B1 144A 24/04/2030	Securitized	0,60 %	Îles Caïmans
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 13/07/2023	Securitized	0,56 %	États-Unis
Gsamp_07-Hsb1 M7 25/02/2047	Securitized	0,54 %	États-Unis
Bpce Sa Mtn 144A 18/01/2027	Banques	0,54 %	France

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

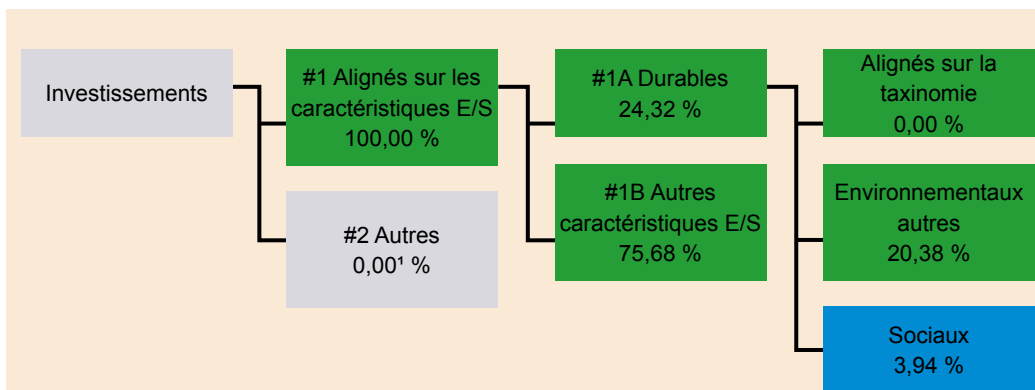
Sustainable Global Bond Income Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

¹ L'exposition nette aux « Autres » actifs a été de -2,06 % en raison des positions dans les instruments dérivés détenues sur le Fonds.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Securitized	ABS	13,73 %
Banques	Autre	13,56 %
Securitized	MBS Pass-Through	9,28 %
Gouvernemental	Souverain	7,67 %
Securitized	CMBS	5,05 %
Technologie	Autre	4,89 %
Électricité	Autre	3,34 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	3,05 %
Communications	Wireless	2,75 %
Trésor	Trésor	2,68 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	2,67 %
Biens de consommation non cyclique	Soins de santé	2,59 %
Gouvernemental	Agence	2,58 %
Communications	Câbles électriques	2,15 %
Communications	Câble et satellite	2,06 %
Securitized	CMO	2,02 %
Industrie de base	Produits chimiques	1,67 %
Biens de consommation cyclique	Construction individuelle	1,50 %
Biens de consommation non cyclique	Alimentation et boissons	1,28 %
Autres secteurs financiers	Autre	1,24 %
Communications	Médias et divertissement	1,18 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	1,17 %
Énergie	Intégrée	1,13 %
Énergie	Midstream	0,20 %
Énergie	Raffinage	0,14 %
Énergie	Indépendante	0,11 %
Énergie	Services de champ pétrolière	0,02 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

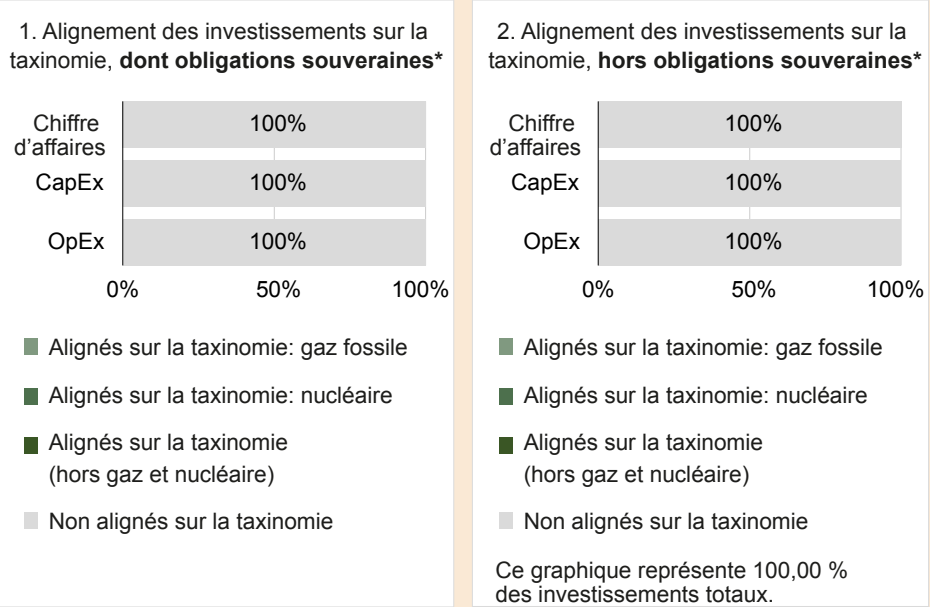
Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 20,38 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

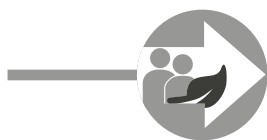
Pour la période de référence, 3,94 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Bond Income Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Infrastructure Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dénomination du produit :
Sustainable Global Infrastructure Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300MW34RL70JW4V90

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

X **Oui**

Non

X Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 77,20 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

X dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

X Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 14,52 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'Investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'Investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Limite ou exclusion (le cas échéant) des investissements directs dans des sociétés émettrices qui, de l'avis du Gestionnaire Financier par délégation, présentaient une exposition ou des liens avec les armes controversées ; la production, la distribution, les licences, la vente au détail ou la fourniture de produits du tabac ou liés au tabac ; la production ou la distribution d'armes à feu ou de munitions de petites armes destinées à des civils ; étaient réputées ne pas avoir respecté un ou plusieurs des dix Principes du Pacte mondial des Nations unies (« PMNU »), qui couvrent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption, sont impliquées dans l'extraction ou la production d'électricité à partir de charbon thermique ou de sables bitumineux (également connus sous le nom de sables pétrolifères)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Infrastructure Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	91,72 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

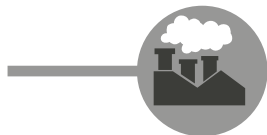
Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Infrastructure Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexactes ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Emissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)
Empreinte carbone
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
Rejets dans l'eau
Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales
Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales
Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
Mixité au sein des organes de gouvernance
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)
Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Infrastructure Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
National Grid Plc	Services aux collectivités	5,50 %	Royaume-Uni
Terna Rete Elettrica Nazionale	Services aux collectivités	5,00 %	Italie
Sba Communications Reit Corp Class	Immobilier	4,98 %	États-Unis
EDP Energias De Portugal Sa	Services aux collectivités	4,70 %	Portugal
Cellnex Telecom Sa	Communication	4,64 %	Espagne
Clearway Energy Inc Class C	Services aux collectivités	4,26 %	États-Unis
Enel	Services aux collectivités	4,20 %	Italie
Smart Metering Systems Plc	Produits industriels	3,85 %	Royaume-Uni
Sse Plc	Services aux collectivités	3,48 %	Royaume-Uni
American Tower Reit Corp	Immobilier	3,39 %	États-Unis
Eversource Energy	Services aux collectivités	3,29 %	États-Unis
Fraport Frankfurt Airport Services	Produits industriels	2,44 %	Allemagne
Severn Trent Plc	Services aux collectivités	2,41 %	Royaume-Uni
Equinix Reit Inc	Immobilier	2,41 %	États-Unis
Nextdc Ltd	Technologie de l'information	2,36 %	Australie

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

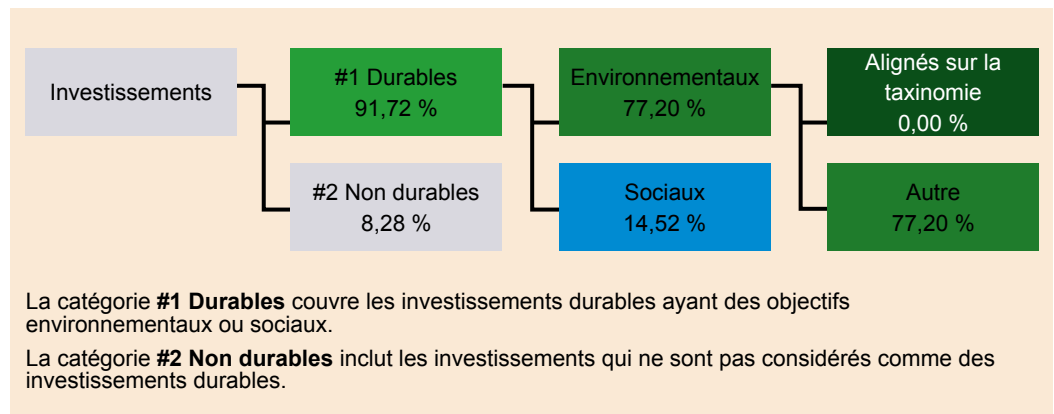
Sustainable Global Infrastructure Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Infrastructure Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Services aux collectivités	Services aux collectivités	45,01 %
Produits industriels	Transports	17,27 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	16,11 %
Communication	Télécommunications	7,88 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	3,83 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	2,82 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,35 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Infrastructure Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

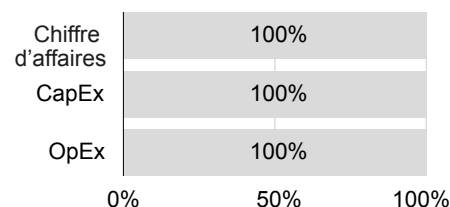
Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

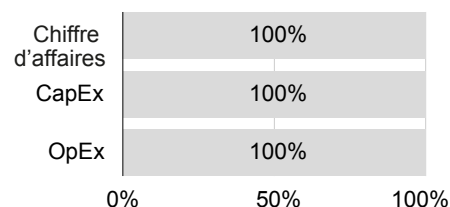
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Infrastructure Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 77,20 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 14,52 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable Global Infrastructure Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Sustainable World Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300GIUUQLJYFN4112

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 25,60 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport au Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (USD hedged) (l'« Indice »)

Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	25,60 %
Limitation des investissements dans des émetteurs réputés avoir des externalités négatives	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport au Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (USD hedged)	Investissements réputés avoir des externalités positives détenus par le Fonds par rapport à l'Indice de Reporting ESG	104,06 % supérieur à l'Indice
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	14,04 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 25,60 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) il a été évalué que l'utilisation du produit contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social, comme des obligations vertes, des obligations sociales ou des obligations durables ; ou
- (iv) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

Pour les obligations qualifiées d'obligations vertes, l'évaluation a été effectuée au niveau de l'émission sur la base de l'utilisation du produit des obligations qui doit être appliquée formellement et exclusivement pour promouvoir le climat ou d'autres objectifs de durabilité environnementale. En outre, certaines garanties minimales et exclusions d'éligibilité ont été intégrées dans la sélection des obligations vertes afin d'éviter l'exposition aux obligations associées à des activités considérées comme ayant des impacts environnementaux et sociaux très négatifs.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

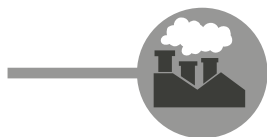
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Exposition accrue à des investissements réputés avoir des externalités positives associées par rapport à l'Indice de Reporting ESG	Investissement dans des obligations avec utilisation du produit
Émissions de gaz à effet de serre (GES)						P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements						P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique						P
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P	
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 14 décembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Allemagne (République fédérale d') RegS 15/10/2027	Trésor	5,91 %	Allemagne
Allemagne (République fédérale d') RegS 15/08/2031	Trésor	1,64 %	Allemagne
Allemagne (République fédérale d') RegS 10/10/2025	Trésor	1,57 %	Allemagne
République populaire de Chine (Gouvernement) 09/04/2025	Trésor	1,23 %	Chine
Bon de trésorerie (2Old) 30/09/2024	Trésor	1,22 %	États-Unis
République populaire de Chine (Gouvernement) 13/05/2028	Trésor	1,10 %	Chine
République populaire de Chine (Gouvernement) 21/05/2030	Trésor	1,05 %	Chine
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 12/01/2023	Securitized	0,88 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 13/03/2023	Securitized	0,87 %	États-Unis
Japon (gouvernement du) 5Yr #148 20/06/2026	Trésor	0,86 %	Japon
UK Conv Gilt 0,375 22/10/26 Regs 22/10/2026	Trésor	0,69 %	Royaume-Uni
République populaire de Chine (Gouvernement) 17/10/2024	Trésor	0,64 %	Chine
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 13/07/2023	Securitized	0,64 %	États-Unis
Mexique (États-Unis mexicains) (29/05/2031)	Trésor	0,62 %	Mexique
République populaire de Chine (Gouvernement) 21/11/2029	Trésor	0,61 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

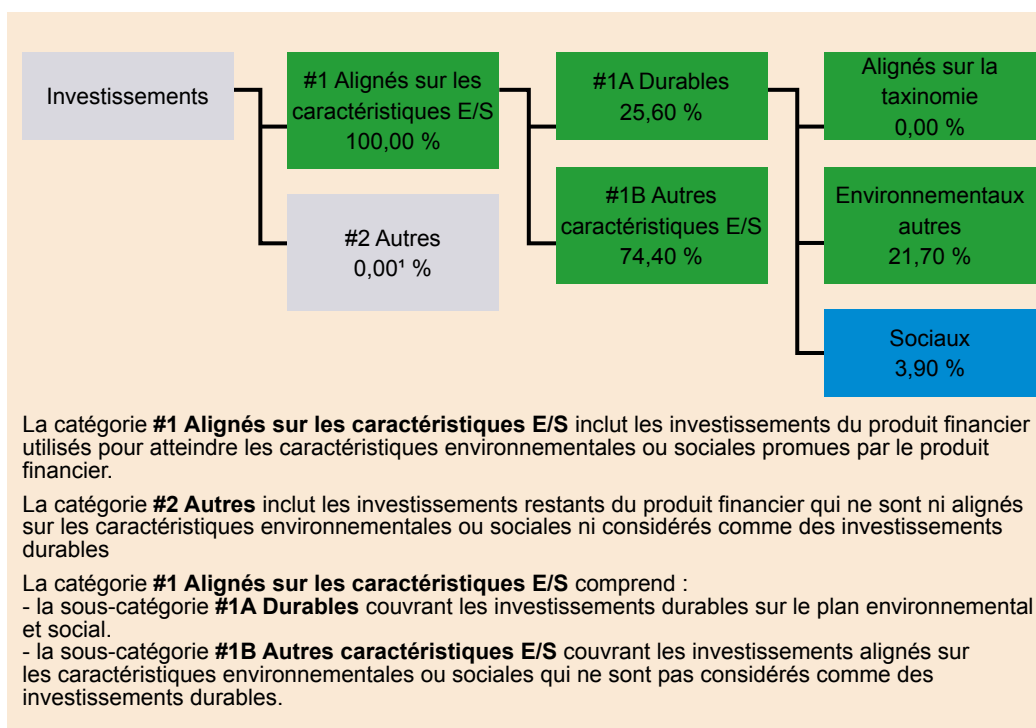
Sustainable World Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



¹ L'exposition nette aux « Autres » actifs a été de -8,72 % en raison des positions dans des instruments dérivés détenues sur le Fonds.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Trésor	Trésor	42,51 %
Securitized	MBS Pass-Through	15,09 %
Banques	Banques	10,15 %
Securitized	ABS	9,64 %
Securitized	CMBS	5,24 %
Technologie	Technologie	3,83 %
Électricité	Électricité	2,24 %
Communications	Câbles électriques	2,09 %
Gouvernemental	Souverain	1,79 %
Gouvernemental	Agence	1,72 %
Securitized	Couvert	1,61 %
Gouvernemental	Supranational	1,37 %
Courtage/Gestionnaires d'actifs/Échanges	Courtage/Gestionnaires d'actifs/Échanges	1,35 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	1,17 %
Communications	Wireless	1,14 %
Communications	Câble et satellite	1,07 %
Securitized	CMO	1,02 %
Énergie	Midstream	0,55 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	0,35 %
Énergie	Intégrée	0,33 %
Énergie	Indépendante	0,13 %
Énergie	Raffinage	0,02 %
Énergie	Services de champ pétrolifère	0,00 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

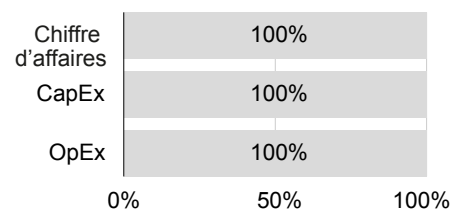
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

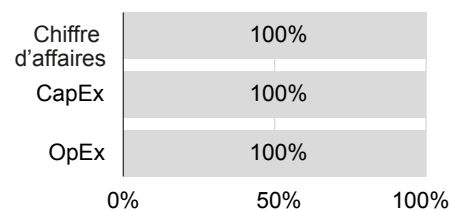
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 21,70 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 3,90 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Sustainable World Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300YOB1KZTW27BE02

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Straumann Holding Ag	Soins de santé	7,91 %	Suisse
Chocoladefabriken Lindt & Spruengl	Produits de consommation courante	7,46 %	Suisse
Barry Callebaut AG	Produits de consommation courante	5,71 %	Suisse
Schindler Holding Ag	Produits industriels	5,23 %	Suisse
Baloise Holding Ag	Finance	4,92 %	Suisse
Burckhardt Compression Holding Ag	Produits industriels	4,69 %	Suisse
Georg Fischer Ag	Produits industriels	4,38 %	Suisse
Dsv	Produits industriels	3,82 %	Danemark
Lonza Group AG	Soins de santé	3,72 %	Suisse
Tecan Group Ag	Soins de santé	3,68 %	Suisse
Belimo N Ag	Produits industriels	3,61 %	Suisse
Sika Ag	Matières premières	3,36 %	Suisse
Vz Holding Ag	Finance	2,77 %	Suisse
Dksh Holding Ag	Produits industriels	2,74 %	Suisse
Roche Holding Ag	Soins de santé	2,54 %	Suisse

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

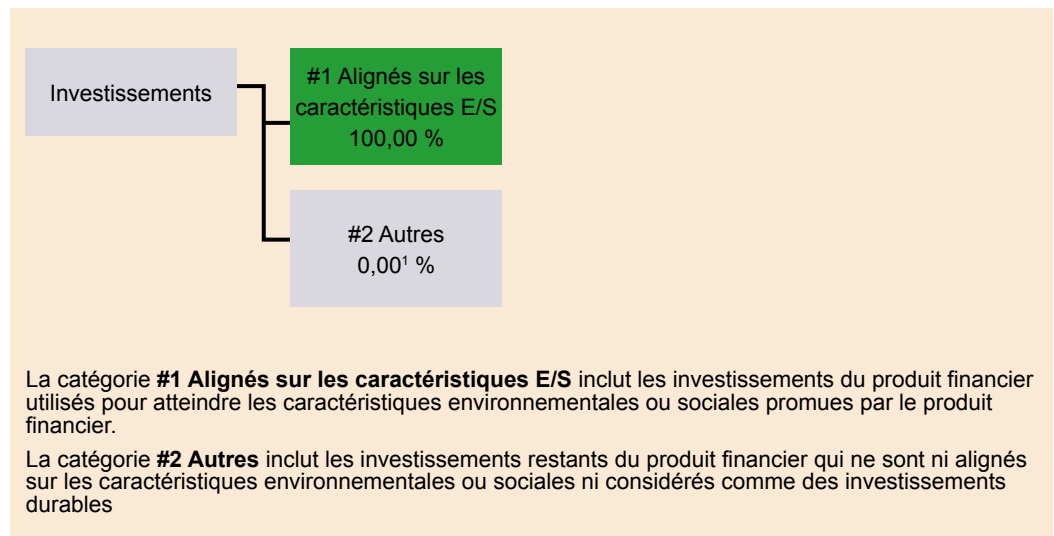
Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



¹ L'exposition nette aux « Autres » actifs a été de -0,01 % en raison des positions dans des instruments dérivés détenues sur le Fonds.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	25,41 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	16,35 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	16,11 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	11,58 %
Finance	Assurance	7,40 %
Finance	Services financiers	4,90 %
Produits industriels	Transports	3,82 %
Matières premières	Matières premières	3,36 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	3,32 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	2,74 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	1,85 %
Fonds communs de placement	Autre	1,68 %
Produits accessoires	Bien durables	1,49 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

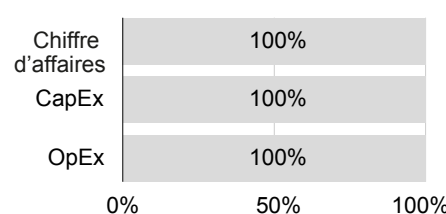
Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission

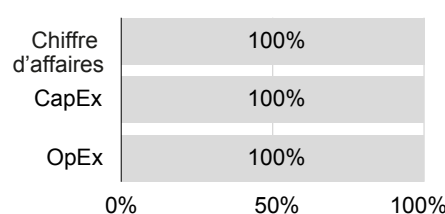
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des liquidités et actions ou parts d'OPC, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Swiss Small & MidCap Opportunities Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Systematic China A-Share Opportunities Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300HIK3R2NF85QQ13

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui **Non**

<p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___%</p>	<p><input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social <p><input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables</p>
--	---

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles			P	P
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Contemporary Ampere Technology Ltd	Produits industriels	4,41 %	Chine
Ping An Insurance (Group) Of China	Finance	4,04 %	Chine
Byd Ltd A	Produits accessoires	3,63 %	Chine
Kweichow Moutai Ltd A	Produits de consommation courante	3,23 %	Chine
Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	Produits accessoires	3,17 %	Chine
China Merchants Bank Ltd A	Finance	2,82 %	Chine
China State Construction Engineering	Produits industriels	2,74 %	Chine
Shenzhen Mindray Bio-Medical Elect	Soins de santé	2,37 %	Chine
Longi Green Energy Technology Ltd	Technologie de l'information	2,28 %	Chine
Wuliangye Yibin Ltd A	Produits de consommation courante	2,17 %	Chine
Tongwei Ltd A	Technologie de l'information	1,89 %	Chine
Boe Technology Group Ltd A	Technologie de l'information	1,89 %	Chine
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory	Produits de consommation courante	1,88 %	Chine
Industrial Bank Ltd A	Finance	1,67 %	Chine
China United Network Communication	Communication	1,67 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

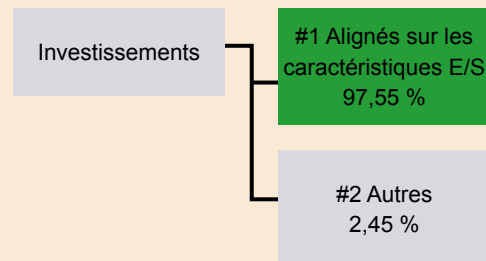
Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	16,27 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	11,63 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	9,14 %
Matières premières	Matières premières	8,62 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	6,93 %
Finance	Banques	6,88 %
Produits accessoires	Bien durables	5,50 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	5,33 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	4,76 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	4,73 %
Finance	Assurance	4,48 %
Finance	Services financiers	3,49 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	1,88 %
Communication	Télécommunications	1,67 %
Produits industriels	Transports	1,48 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	1,13 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,37 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

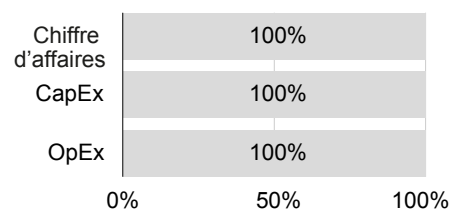
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

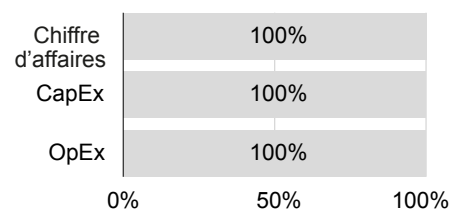
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 30 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Systematic China A-Share Opportunities Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Systematic China Environmental Tech Fund

Identifiant d'entité juridique :
529900A0JA146KNY9O73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 62,98 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Maintenir que le Fonds détienne au moins 70 % d'investissements dans des sociétés des secteurs de l'énergie nouvelle, de la neutralité carbone, de l'énergie verte, de la conservation de l'énergie et de la réduction des émissions

Investissement dans des Investissements durables

Amélioration du score ESG ajusté par rapport au MSCI China All Share IMI Environmental 10/40 Index (l'« Indice »)

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	62,98 %
Maintenir que le Fonds détienne au moins 70 % d'investissements dans des sociétés des secteurs de l'énergie nouvelle, de la neutralité carbone, de l'énergie verte, de la conservation de l'énergie et de la réduction des émissions	d'investissements dans des sociétés des secteurs de l'énergie nouvelle, de la neutralité carbone, de l'énergie verte, de la conservation de l'énergie et de la réduction des émissions	97,86 %
Amélioration du score ESG ajusté par rapport à l'indice MSCI China All Share IMI Environmental 10/40 Index	% d'amélioration du score ESG par rapport à l'indice	7,89 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 62,98 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un atteindre un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

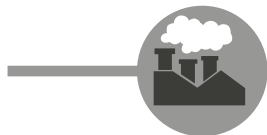
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 15 juin 2023 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Li Auto Class A Inc	Produits accessoires	11,24 %	Chine
Contemporary Amperex Technology Ltd	Produits industriels	9,06 %	Chine
Nio American Depositary Shares Rep	Produits accessoires	5,96 %	Chine
Xpeng Class A Inc	Produits accessoires	5,28 %	Chine
Longi Green Energy Technology Ltd	Technologie de l'information	4,20 %	Chine
Goldwind Science&Technology Ltd A	Produits industriels	3,38 %	Chine
Geely Automobile Holdings Ltd	Produits accessoires	2,58 %	Hong Kong
Byd Ltd A	Produits accessoires	2,56 %	Chine
Offshore Oil Engineering Ltd A	Énergie	2,54 %	Chine
China State Construction Engineering	Produits industriels	2,54 %	Chine
Risen Energy Ltd A	Technologie de l'information	2,49 %	Chine
Yutong Bus Ltd A	Produits industriels	2,47 %	Chine
Weichai Power Ltd A	Produits industriels	2,47 %	Chine
Ja Solar Technology Ltd A	Technologie de l'information	2,45 %	Chine
Gongniu Group Ltd A	Produits industriels	2,32 %	Chine

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

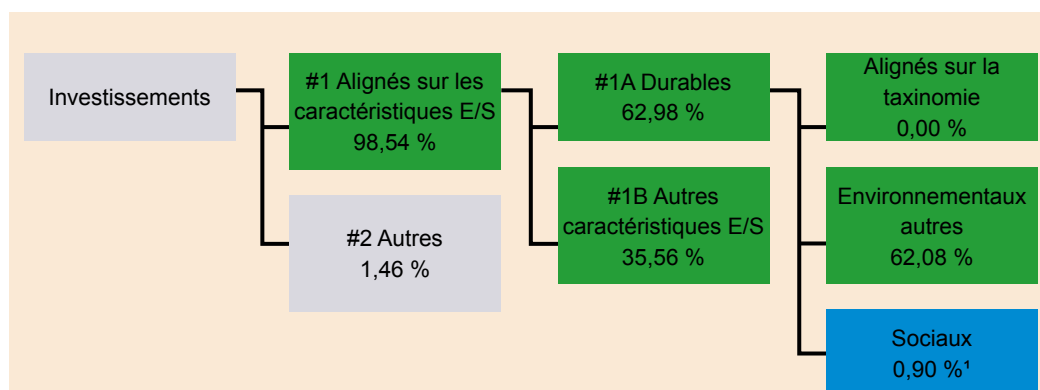
Systematic China Environmental Tech Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

¹ Le 15 juin 2023, le Fonds s'est engagé à avoir un minimum de 1 % d'Investissements durables ayant un objectif social dans le prospectus. Au 31 août 2023, le Fonds détenait un montant inférieur à cet engagement minimum de 1 %. La violation passive s'est produite en raison des mouvements du marché et a été identifiée et corrigée dans le cadre du processus standard de résolution des violations de BlackRock.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits accessoires	Automobiles et composants	36,65 %
Produits industriels	Biens d'équipement	32,74 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	12,52 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	8,37 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	2,86 %
Énergie	Services d'équipement pétrolier et gazier	2,54 %
Produits industriels	Transports	1,27 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz ou charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

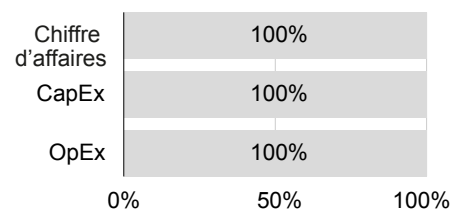
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

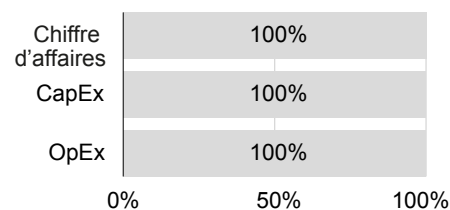
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 62,08 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 0,90 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic China Environmental Tech Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Systematic Global Sustainable Income & Growth Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300VKXVTNB9CQJ249

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 29,09 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Investissement dans des obligations avec utilisation du produit

Maintien d'une notation ESG moyenne pondérée du Fonds supérieure à la notation ESG de 33,3 % du MSCI World Minimum Volatility Index, 33,3 % du MSCI All Country World Index, 16,7 % du BBG Global Aggregate Corporate Index et 16,7 % du BBG Global High Yield Corp ex Emerging Markets Index Hedged in USD (l'« Indice ») après avoir éliminé au moins 20 % des titres les moins bien notés de l'Indice Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à l'Indice

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	29,09 %
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million \$ de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport à l'Indice	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-55,13 %
Investissement dans des obligations avec utilisation du produit	% d'obligations avec utilisation du produit détenues par le Fonds	0,99 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 29,09 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (iii) les titres à revenu fixe ont été alignés sur un objectif environnemental et/ou social.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Réduction des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à l'indice de référence
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P	
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 22 septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Microsoft Corp	Technologie de l'information	1,85 %	États-Unis
Apple Inc	Technologie de l'information	1,05 %	États-Unis
Unitedhealth Group Inc	Soins de santé	0,99 %	États-Unis
Pepsico Inc	Produits de consommation courante	0,94 %	États-Unis
Merck & Co Inc	Soins de santé	0,90 %	États-Unis
Gilead Sciences Inc	Soins de santé	0,79 %	États-Unis
Texas Instrument Inc	Technologie de l'information	0,78 %	États-Unis
Coca-Cola	Produits de consommation courante	0,76 %	États-Unis
WW Grainger Inc	Produits industriels	0,76 %	États-Unis
Home Depot Inc	Produits accessoires	0,75 %	États-Unis
General Mills Inc	Produits de consommation courante	0,74 %	États-Unis
Novo Nordisk Class B	Soins de santé	0,71 %	Danemark
Automatic Data Processing Inc	Produits industriels	0,70 %	États-Unis
Amazon Com Inc	Produits accessoires	0,70 %	États-Unis
Kellogg	Produits de consommation courante	0,70 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

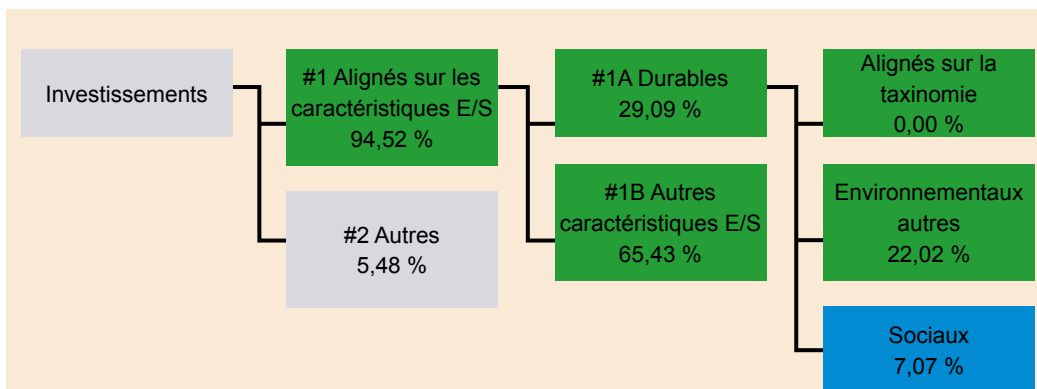
Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	8,69 %
Finance	Banques	6,82 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	6,21 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	6,05 %
Produits industriels	Biens d'équipement	5,96 %
Communication	Télécommunications	4,95 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	4,83 %
Finance	Services financiers	4,58 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	4,24 %
Matières premières	Matières premières	4,04 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	3,93 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	3,72 %
Finance	Assurance	3,37 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	2,98 %
Communication	Médias et divertissement	2,96 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	2,75 %
Produits industriels	Transports	2,29 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	2,17 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	1,85 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	1,72 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	1,68 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	1,44 %
Produits accessoires	Bien durables	1,33 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	1,15 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	1,02 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,76 %
Énergie	Équipements et services pétroliers et gaziers	0,53 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	0,35 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,27 %
Énergie	Charbon et combustibles	0,00 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

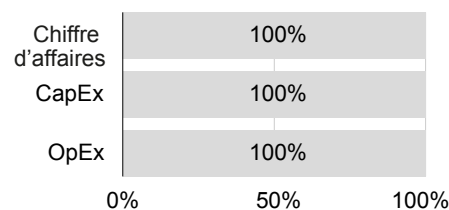
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

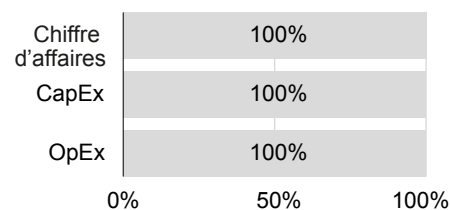
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 22,02 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 7,07 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Global Sustainable Income and Growth Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300UUNQOH7ZDYR32

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Maintien d'un score ESG supérieur à celui du Bloomberg Global Aggregate Corporate USD Hedged Index pour les titres de créance d'entreprise investment grade

Maintien d'un score ESG supérieur à celui du Bloomberg Global High Yield Index Excl CMBS & EMG 2% Capped USD Hedged Index pour les titres de créance d'entreprise à haut rendement

Maintien d'un score d'intensité des émissions carbone inférieur à celui du Bloomberg Global Aggregate Corporate USD Hedged Index pour les titres de créance d'entreprises investment grade

Maintien d'un score d'intensité des émissions carbone inférieur à celui du Bloomberg Global High Yield Index Excl CMBS & EMG 2% Capped USD Hedged Index pour les titres de créance d'entreprises à haut rendement

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Maintien d'un score ESG supérieur à celui du Bloomberg Global High Yield Index Excl CMBS & EMG 2% Capped USD Hedged Index pour les titres de créance d'entreprise à haut rendement	% d'amélioration du score ESG par rapport à l'indice	10,07 %
Maintien d'un score d'intensité des émissions carbone inférieur à celui du Bloomberg Global Aggregate Corporate USD Hedged Index pour les titres de créance d'entreprises investment grade	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-49,68 %
Maintien d'un score d'intensité des émissions carbone inférieur à celui du Bloomberg Global High Yield Index Excl CMBS & EMG 2% Capped USD Hedged Index pour les titres de créance d'entreprises à haut rendement	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-30,82 %
Maintien d'un score ESG supérieur à celui du Bloomberg Global Aggregate Corporate USD Hedged Index pour les titres de créance d'entreprise investment grade	% d'amélioration du score ESG par rapport à l'indice	10,31 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

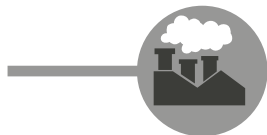
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité					
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	En ce qui concerne les titres de créance d'entreprise d'investissement grade, les critères ESG appliqués par le Fonds consistent à obtenir un score d'intensité des émissions carbone inférieur à celui du Bloomberg Global High Yield Index Excl CMBS & EMG 2 % Capped USD Hedged Index.	En ce qui concerne les titres de créance d'entreprises à haut rendement, les critères appliqués par le Fonds consistent à obtenir un score d'intensité des émissions carbone inférieur à celui du Bloomberg Global High Yield Index Excl CMBS & EMG 2 % Capped USD Hedged Index.
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P	P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P	P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P			
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P		
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E					

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Qatar (État du) Regs	Gouvernemental	0,39 %	Qatar
Hongrie (Gouvernement) Regs	Gouvernemental	0,38 %	Hongrie
Directv Financing Llc 144A	Industrie	0,36 %	États-Unis
Uruguay (République orientale d')	Gouvernemental	0,36 %	Uruguay
Perusahaan Penerbit Surat Berharga Mtn Regs	Gouvernemental	0,36 %	Indonésie
Abou Dabi (Émirat d') Regs	Gouvernemental	0,35 %	Émirats arabes unis
Qatar État du (Gouvernement) Regs	Gouvernemental	0,32 %	Union européenne
Sultanat d'Oman (Gouvernement) Regs	Gouvernemental	0,32 %	Qatar
Oman Sovereign Sukuk Saoc Regs	Gouvernemental	0,32 %	Chili
Chili (République du)	Gouvernemental	0,32 %	Oman
Kazakhstan (République du) Regs	Gouvernemental	0,31 %	Oman
Qatar (État du) Regs	Gouvernemental	0,30 %	Kazakhstan
Jpmorgan Chase & Co	Institutions financières	0,29 %	Qatar
Philippines (République des)	Gouvernemental	0,29 %	États-Unis
Jamaïque (Gouvernement)	Gouvernemental	0,29 %	Philippines

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

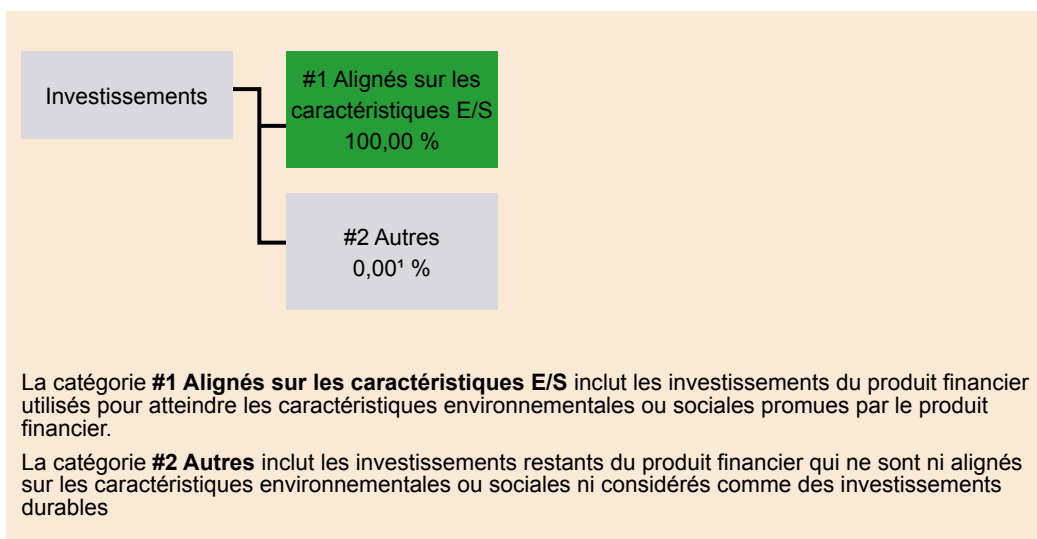
ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



¹ L'exposition nette aux « Autres » actifs a été de -0,20 % en raison des positions dans des instruments dérivés détenues sur le Fonds.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Gouvernemental	Souverain	33,40 %
Banques	Autre	7,84 %
Technologie	Autre	5,48 %
Gouvernemental	Agence	3,93 %
Biens de consommation non cyclique	Soins de santé	3,11 %
Communications	Câble et satellite	2,31 %
Biens de consommation non cyclique	Alimentation et boissons	2,29 %
Énergie	Midstream	2,20 %
Communications	Câbles électriques	2,17 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	1,97 %
Électricité	Autre	1,93 %
Biens de consommation non cyclique	Produits pharmaceutiques	1,57 %
Biens de consommation cyclique	Services de consommation cyclique	1,54 %
Communications	Médias et divertissement	1,54 %
Biens d'équipement	Manufacture diversifiée	1,48 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	1,48 %
Biens de consommation cyclique	Détaillants	1,44 %
Autre	Autre	1,36 %
Communications	Wireless	1,33 %
Biens d'équipement	Matériaux de construction	1,29 %
Énergie	Services de champ pétrolifère	1,29 %
Énergie	Indépendante	1,14 %
Autres industries	Autre	1,12 %
Sociétés de financement	Autre	1,09 %
Énergie	Intégrée	0,55 %
Énergie	Raffinage	0,49 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

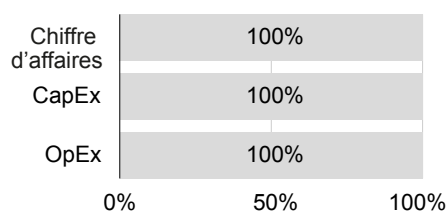
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

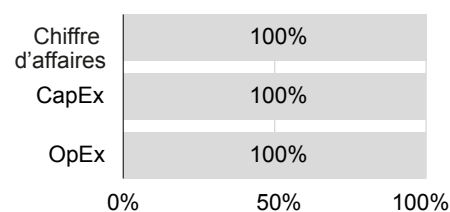
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

ESG Systematic Multi Allocation Credit Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
Systematic Sustainable Global Small Cap Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300HBMGWEEZN5BI34

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 24,21 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien d'une notation ESG moyenne pondérée du Fonds supérieure à celle du MSCI ACWI

Small Cap Index (l'« Indice ») après avoir éliminé au moins 20 % des titres les moins bien notés de l'Indice Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de

vente des avoirs du Fonds) par rapport au MSCI ACWI Small Cap Index

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	24,21 %
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice MSCI ACWI Small Cap Index après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les moins bonnes notes de l'Indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : A (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détentions du Fonds) par rapport au MSCI ACWI Small Cap Index	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-40,59 %
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 24,21 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un atteindre un objectif environnemental et/ou social.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

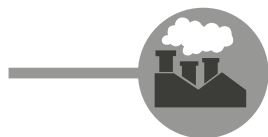
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détections du Fonds) par rapport à l'indice de référence
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P	
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 14 décembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Tokyo Tatemono Ltd	Immobilier	0,93 %	Japon
Gibson Energy Inc	Énergie	0,93 %	Canada
Teradata Corp	Technologie de l'information	0,85 %	États-Unis
Oshkosh Corp	Produits industriels	0,73 %	États-Unis
Comfort Systems Usa Inc	Produits industriels	0,71 %	États-Unis
Boyd Gaming Corp	Produits accessoires	0,69 %	États-Unis
Siteone Landscape Supply Inc	Produits industriels	0,61 %	États-Unis
Insperty Inc	Produits industriels	0,57 %	États-Unis
Bawag Group Ag	Finance	0,57 %	Autriche
King Yuan Electronics Ltd	Technologie de l'information	0,57 %	Taiwan (République de Chine)
Manhattan Associates Inc	Technologie de l'information	0,55 %	États-Unis
Apogee Enterprises Inc	Produits industriels	0,54 %	États-Unis
J.Front Retailing Ltd	Produits accessoires	0,53 %	Japon
Enovis Corp	Soins de santé	0,53 %	États-Unis
Huntsman Corp	Matières premières	0,52 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

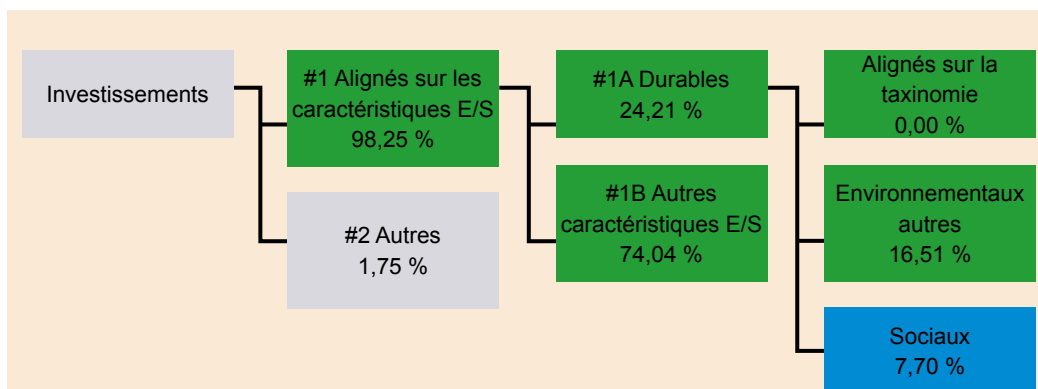
Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Produits industriels	Biens d'équipement	13,48 %
Matières premières	Matières premières	7,30 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	6,11 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	6,09 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	5,91 %
Finance	Services financiers	4,84 %
Finance	Banques	4,67 %
Immobilier	Sociétés de placement immobilier (REIT)	4,46 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	4,25 %
Produits accessoires	Bien durables	3,91 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	3,86 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	3,35 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	3,34 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	3,19 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	3,11 %
Services aux collectivités	Services aux collectivités	2,92 %
Communication	Médias et divertissement	2,39 %
Produits industriels	Transports	2,33 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	1,96 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	1,81 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	1,57 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	1,52 %
Communication	Télécommunications	1,37 %
Finance	Assurance	1,36 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	1,34 %
Énergie	Services d'équipement pétrolier et gazier	0,91 %
Énergie	Raffinage et marketing pétroliers et gaziers	0,11 %
Énergie	Forage pétrolier et gazier	0,10 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (tels que définis par le Global Industry Classification System) : pétrole et gaz intégrés, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

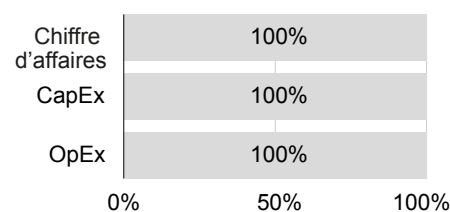
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

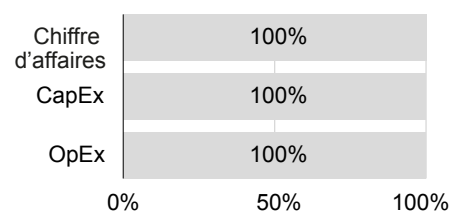
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 16,51 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 7,70 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

Systematic Sustainable Global Small Cap Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
US Dollar High Yield Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493002GUOE4D10RFV09

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Picard Midco Inc 144A 31/03/2029	Technologie	0,91 %	États-Unis
Clarios Global Lp 144A 15/05/2027	Biens de consommation cyclique	0,84 %	Canada
Verscend Escrow Corp 144A 15/08/2026	Technologie	0,73 %	États-Unis
Zayo Group Holdings Inc 144A 01/03/2027	Communications	0,71 %	États-Unis
Mauser Packaging Solutions Holding 144A 15/08/2026	Biens d'équipement	0,68 %	États-Unis
Alliant Holdings Intermediate Llc 144A 15/10/2027	Assurance	0,65 %	États-Unis
Carnival Holdings (Bermudes) Ltd 144A 01/05/2028	Biens de consommation cyclique	0,63 %	Bermudes
Entegris Escrow Corp 144A 15/04/2029	Technologie	0,57 %	États-Unis
Element Solutions Inc 144A 01/09/2028	Industrie de base	0,54 %	États-Unis
United Rentals (North America) Inc 144A 15/12/2029	Biens d'équipement	0,52 %	États-Unis
Nfp Corp 144A 15/08/2028	Courtage/Gestionnaires d'actifs/Échanges	0,51 %	États-Unis
Big River Steel Llc 144A 31/01/2029	Industrie de base	0,51 %	États-Unis
Connect Finco Sarl 144A 01/10/2026	Communications	0,50 %	Luxembourg
Minerva Merger Sub Inc 144A 15/02/2030	Technologie	0,47 %	États-Unis
Tk Elevator Us Newco Inc 144A 15/07/2027	Biens d'équipement	0,47 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

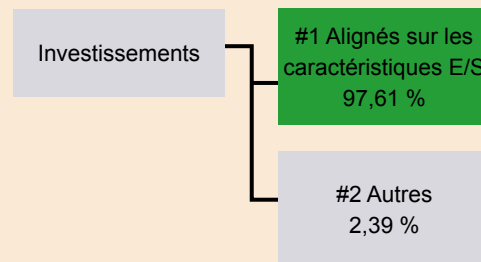
US Dollar High Yield Bond Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Technologie	Autre	11,96 %
Énergie	Midstream	6,28 %
Énergie	Indépendante	5,08 %
Communications	Câble et satellite	4,76 %
Biens de consommation cyclique	Services de consommation cyclique	4,22 %
Biens de consommation cyclique	Loisirs	3,86 %
Biens de consommation cyclique	Jeux	3,76 %
Communications	Câbles électriques	3,71 %
Biens de consommation non cyclique	Soins de santé	3,59 %
Biens d'équipement	Manufacture diversifiée	3,24 %
Biens de consommation cyclique	Automobiles	2,98 %
Biens d'équipement	Conditionnements	2,94 %
Industrie de base	Métaux et exploitation minière	2,92 %
Assurance	Biens et sinistres	2,80 %
Industrie de base	Produits chimiques	2,66 %
Communications	Médias et divertissement	2,47 %
Securitized	ABS	2,47 %
Énergie	Services de champ pétrolière	2,39 %
Biens d'équipement	Matériaux de construction	2,32 %
Transports	Compagnies aériennes	1,95 %
Communications	Wireless	1,94 %
Banques	Autre	1,91 %
Biens de consommation non cyclique	Alimentation et boissons	1,88 %
Biens d'équipement	Aérospatiale et Défense	1,42 %
Biens de consommation cyclique	Détaillants	1,40 %
Sociétés de financement	Autre	1,35 %
Courtage/Gestionnaires d'actifs/Échanges	Autre	1,34 %
Autres industries	Autre	1,08 %
Biens d'équipement	Environnementaux	1,07 %
Biens d'équipement	Machines de construction	1,01 %
Énergie	Raffinage	0,05 %
Énergie	Intégrée	0,01 %

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

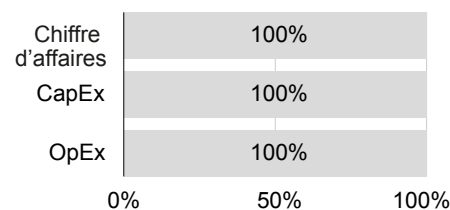
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

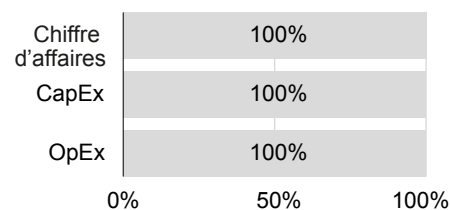
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des gouvernements et organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Dollar High Yield Bond Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
US Flexible Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493000VBLDY9YB8P237

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 14 décembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Microsoft Corp	Technologie de l'information	6,65 %	États-Unis
Amazon Com Inc	Produits accessoires	4,41 %	États-Unis
Apple Inc	Technologie de l'information	3,91 %	États-Unis
Comcast Corp Class A	Communication	2,87 %	États-Unis
Berkshire Hathaway Inc Class B	Finance	2,58 %	États-Unis
Alphabet Inc Class A	Communication	2,40 %	États-Unis
Meta Platforms Inc Catégorie A	Communication	2,22 %	États-Unis
Corteva Inc	Matières premières	2,19 %	États-Unis
Unitedhealth Group Inc	Soins de santé	2,16 %	États-Unis
Applied Material Inc	Technologie de l'information	2,14 %	États-Unis
Sanofi Adr Representing Sa	Soins de santé	2,14 %	France
Fortive Corp	Produits industriels	1,97 %	États-Unis
Alphabet Inc Class C	Communication	1,93 %	États-Unis
Ross Stores Inc	Produits accessoires	1,88 %	États-Unis
Novo-Nordisk Adr Repsg B	Soins de santé	1,82 %	Danemark

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

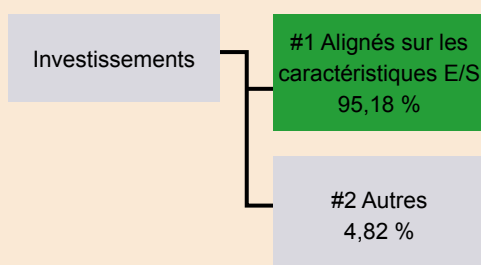
US Flexible Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Communication	Médias et divertissement	11,13 %
Finance	Services financiers	10,77 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	8,89 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	8,62 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	6,61 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	5,83 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	5,37 %
Produits industriels	Biens d'équipement	5,33 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	4,92 %
Matières premières	Matières premières	4,28 %
Produits de consommation courante	Nourriture Boissons Tabac	3,14 %
Finance	Assurance	3,09 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,90 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	2,74 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	2,47 %
Finance	Banques	2,10 %
Énergie	Pétrole et gaz intégrés	1,67 %
Produits accessoires	Bien durables	1,23 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	1,20 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	1,20 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	1,10 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

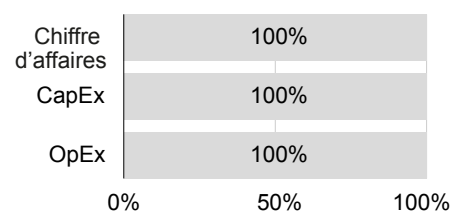
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

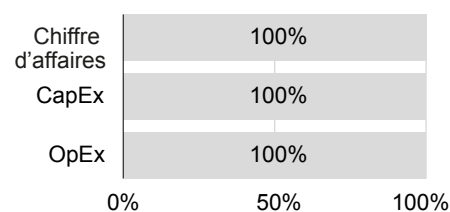
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund (suite)

- **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental** au titre du Règlement (UE) 2020/852.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



- **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Flexible Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
US Government Mortgage Impact Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300SQECI78I3LC791

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : 43,77 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : 43,77 %

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)



Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le tableau suivant présente les objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds tout au long de la période de référence. De plus amples informations sur ces objectifs d'Investissement durable sont présentées dans le prospectus du Fonds. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds atteint ces objectifs d'Investissement durable.

Objectifs d'Investissement durable promus par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacun des objectifs d'Investissement durable du Fonds, comme présenté plus en détail dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	87,54 % ¹
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Maintien d'une stratégie d'investissement qui réduit l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 %	Réduction de l'univers d'investissement	La politique ESG a réduit l'univers d'investissement de plus de 20 % sur la période de référence
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs

¹Pendant la période de référence, le Fonds a connu une violation active. Un fonds de l'Article 9 ne doit détenir que des Investissements durables, à l'exception des instruments utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. À la suite de la mise en œuvre du SFDR Niveau 2 le 1er janvier 2023, il a été estimé qu'une partie des participations du Fonds composées de titres CMO, CMBS et MBS Pool ne répondaient pas aux critères pour être considérées comme des Investissements durables ou des instruments utilisés à des fins de gestion de liquidités et/ou de couverture. Une mesure corrective a été prise les 5 et 6 janvier 2023 pour supprimer les titres non éligibles du Fonds. Les violations ont été signalées dans le cadre du processus standard de résolution des violations de Blackrock.

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

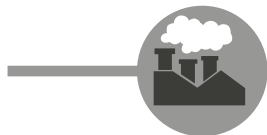
- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs réputés avoir violé ces conventions ne sont pas considérés comme des Investissements durables.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement cause un préjudice important, en se référant à toutes les principales incidences négatives obligatoires (PIN) pertinentes. Les critères ciblent des facteurs de durabilité, par ex. les sociétés bénéficiaires d'investissements exposées aux combustibles fossiles, les violations des normes internationales, les pratiques commerciales néfastes pour l'environnement et les armes controversées. Les investissements sont examinés par rapport à ces critères à l'aide de contrôles basés sur un système. Ceux considérés comme nuisant de manière significative à un objectif ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables. BlackRock évalue les indicateurs d'incidences négatives sur les facteurs de durabilité pour chaque type d'investissement, comme défini par la réglementation. Les critères d'incidences négatives sont évalués à l'aide de données de prestataires tiers portant sur l'implication commerciale d'un investissement (dans des activités spécifiques identifiées comme ayant des impacts environnementaux ou sociaux négatifs) ou sur des controverses environnementales ou sociales, afin d'exclure les investissements que BlackRock estime néfastes pour les indicateurs de durabilité, sous réserve de quelques exceptions, par exemple, s'il a été déterminé que les données sont inexactes ou obsolètes.

Les PIN suivantes sont capturées par le processus « ne pas nuire de manière significative » :

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité

Emissions de gaz à effet de serre (GES) (de niveau 1/2/3)
Empreinte carbone
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
Part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
Intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
Rejets dans l'eau
Ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales
Absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales
Écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
Mixité au sein des organes de gouvernance
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)
Intensité de GES (émetteurs souverains ou supranationaux)
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (émetteurs souverains ou supranationaux)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion** d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Gnma2 30Yr 20/09/2051	Securitized	11,07 %	États-Unis
Fhlmc 30Yr Umbs Super 01/02/2051	Securitized	9,46 %	États-Unis
FNMA 30Yr Umbs 01/05/2051	Securitized	5,54 %	États-Unis
Gnma2 30Yr 20/10/2051	Securitized	3,49 %	États-Unis
Gnma2 30Yr 20/06/2050	Securitized	3,41 %	États-Unis
Gnma2 30Yr Tba(Reg C) 21/09/2023	Securitized	3,16 %	États-Unis
Gnma2 30Yr Tba(Reg C) 20/06/2023	Securitized	2,98 %	États-Unis
Umbs 30Yr Tba(Reg A) 12/01/2023	Securitized	2,89 %	États-Unis
Gnma2 30Yr Tba(Reg C) 21/03/2023	Securitized	2,88 %	États-Unis
Gnma2 30Yr 20/06/2050	Securitized	2,81 %	États-Unis
FNMA 30Yr Umbs 01/09/2051	Securitized	2,74 %	États-Unis
Gnma2 30Yr 20/03/2051	Securitized	2,37 %	États-Unis
Gnma2 30Yr 20/03/2051	Securitized	2,36 %	États-Unis
Gnma2 30Yr 2020 Production 20/06/2050	Securitized	2,23 %	États-Unis
Gnma2 30Yr 20/06/2050	Securitized	2,22 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

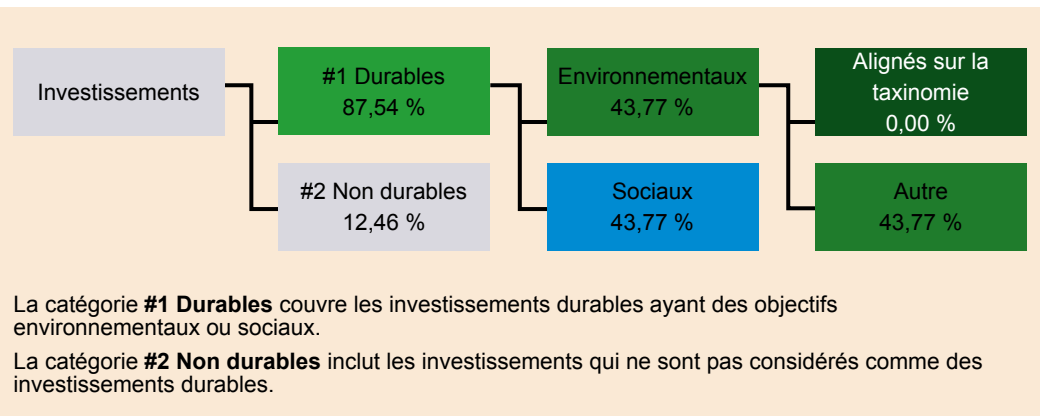
US Government Mortgage Impact Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Securitized	MBS Pass-Through	95,92 %
Securitized	CMO	3,43 %
Trésor	Trésor	2,81 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Barclays Industry Classification System) : intégrés, indépendants, midstream, services du secteur pétrolier, raffinage, métaux et exploitation minière.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires sont des activités économiques** pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

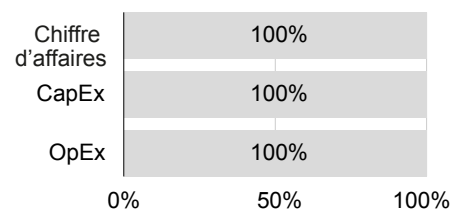
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

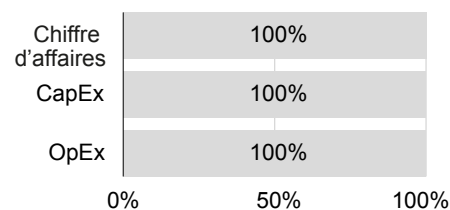
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



* Investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables* ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 43,77 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 43,77 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « Non durables » pouvaient comprendre des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités et des titres à revenu fixe négociables (également appelés titres de créance) émis par des organismes du monde entier, sans que ces détentions n'excèdent 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins de gestion des liquidités et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prend dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, 1er alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Government Mortgage Impact Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint l'objectif d'investissement durable.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence aux fins d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
US Growth Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300DS7VHS2W0PZD71

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 14 décembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Microsoft Corp	Technologie de l'information	8,46 %	États-Unis
Apple Inc	Technologie de l'information	8,29 %	États-Unis
Amazon Com Inc	Produits accessoires	7,85 %	États-Unis
Alphabet Inc Class A	Communication	5,21 %	États-Unis
Visa Inc Class A	Finance	5,09 %	États-Unis
Nvidia Corp	Technologie de l'information	4,81 %	États-Unis
Intuit Inc	Technologie de l'information	4,73 %	États-Unis
Asml Holding Adr Representing Nv	Technologie de l'information	4,04 %	Pays-Bas
Cadence Design Systems Inc	Technologie de l'information	3,37 %	États-Unis
Unitedhealth Group Inc	Soins de santé	3,22 %	États-Unis
Tesla Inc	Produits accessoires	3,21 %	États-Unis
Copart Inc	Produits industriels	3,19 %	États-Unis
S&P Global Inc	Finance	3,09 %	États-Unis
Danaher Corp	Soins de santé	3,06 %	États-Unis
Intuitive Surgical Inc	Soins de santé	2,99 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

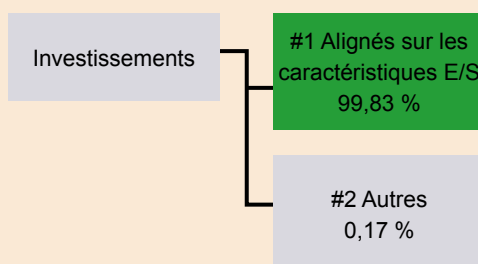
US Growth Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Technologie de l'information	Logiciels et services	20,43 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	11,84 %
Finance	Services financiers	11,43 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	8,45 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	8,29 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	7,85 %
Communication	Médias et divertissement	7,57 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	7,41 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	4,24 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	3,73 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	3,21 %
Produits accessoires	Bien durables	2,99 %
Produits industriels	Biens d'équipement	1,55 %
Énergie	Stockage et transport pétroliers et gaziers	1,38 %
Énergie	Exploration et produits pétroliers et gaziers	0,08 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : pétrole et gaz intégrés, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

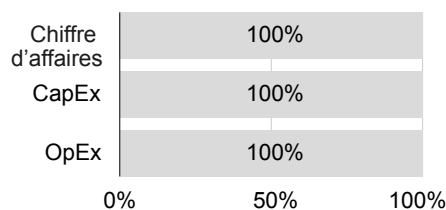
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

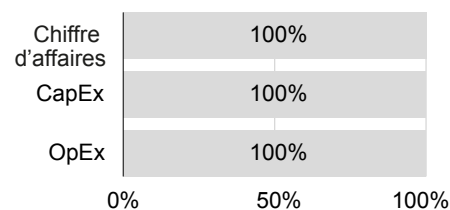
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.**



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



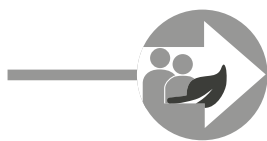
● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

US Growth Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
US Sustainable Equity Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300KZU3AFC0XHX480

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 50,16 % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Investissement dans des Investissements durables

Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice Russell 1000 Index (l'« Indice ») après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice

Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détections du Fonds) par rapport à l'indice Russell 1000 Index.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'armes nucléaires ou de composants d'armes nucléaires ou de plateformes de livraison, ou de la fourniture de services auxiliaires liés aux armes nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à base de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes », qui sont considérées conformes aux Principes des obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production, de la distribution, de la vente et de la fourniture de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution (vente en gros ou au détail) d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Limiter les investissements directs dans des titres d'émetteurs impliqués dans : la production et la vente au détail de produits alcoolisés ; la propriété ou l'exploitation d'activités ou d'installations liées aux jeux de hasard ; les activités d'exploitation minière, de production et d'approvisionnement liées à l'énergie nucléaire ; la production de supports de divertissement pour adultes ; la production non conventionnelle de pétrole et de gaz ; la production d'armes conventionnelles.

Exclusion des émetteurs qui ne présentent pas une notation de B ou plus, comme défini par les notations ESG Intangible Value Assessment Ratings de MSCI ou un autre fournisseur de données ESG équivalent

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active
Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG	% d'émetteurs notés ESG	Plus de 90 % des émetteurs
Maintien de la note ESG moyenne pondérée du Fonds au-dessus de la note ESG de l'indice après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice	Notation ESG du Fonds	Notation ESG du Fonds : AA (Notation ESG du Fonds supérieure à la Notation de l'Indice pendant toute la période de référence, après élimination d'au moins 20 % des titres ayant les notes les plus basses de l'Indice)
Réduction de l'intensité des émissions carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice Russell 1000 Index.	Intensité des émissions carbone par rapport à l'Indice	-61,67 %
Investissement dans des Investissements durables	% d'Investissements durables détenus par le Fonds	50,16 %

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Pendant la période de référence, le Fonds a investi 50,16 % de ses détentions dans des Investissements durables pour atteindre son objectif d'investissement.

Objectifs environnementaux et sociaux

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui ont contribué à divers objectifs environnementaux et/ou sociaux qui peuvent entre autres inclure les énergies alternatives et renouvelables, l'efficacité énergétique, la prévention ou l'atténuation de la pollution, la réutilisation et le recyclage, la santé, la nutrition, l'assainissement et l'éducation, ainsi que les Objectifs de développement durable des Nations unies et d'autres cadres liés au développement durable (« Objectifs environnementaux et sociaux »).

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)

Évaluation de l'activité économique

On considère qu'un investissement contribue à atteindre un objectif environnemental et/ou social si :

- (i) une proportion minimale de l'activité commerciale de l'émetteur a contribué à atteindre un objectif environnemental et/ou social ; ou
- (ii) les pratiques commerciales de l'émetteur ont contribué à un objectif environnemental et/ou social.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les Investissements durables détenus par le Fonds pendant la période de référence ne répondaient pas à l'exigence de ne pas causer de préjudice important (« DNSH »), comme défini par la loi et la réglementation applicables. BlackRock a développé un ensemble de critères sur tous les Investissements durables afin d'évaluer si un émetteur ou un investissement causent un préjudice important. Les investissements considérés comme causant un préjudice important ne peuvent pas être qualifiés d'Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs sur les principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de développement durable de chaque type d'investissement ont été évalués à l'aide de la méthodologie propriétaire de BlackRock Sustainable Investments. Tous les indicateurs de PIN obligatoires pertinents inclus dans l'Annexe 1 du Règlement délégué (UE) 22/1288 de la Commission ont été pris en compte. BlackRock utilise une analyse fondamentale et/ou des sources de données tierces pour identifier les investissements qui ont une incidence négative sur les facteurs de développement durable et qui causent un préjudice important. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les Investissements durables détenus pendant la période de référence ont été évalués pour tenir compte des incidences négatives et s'assurer de la conformité aux normes internationales issues des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et des principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, y compris aux principes et aux droits énoncés dans les huit conventions fondamentales identifiées dans la Déclaration de l'Organisation internationale du travail sur les Principes et droits fondamentaux au travail et sur la Charte internationale des droits de l'homme. Les émetteurs ou les entreprises réputées avoir violé ces conventions ne sont pas considérées comme des Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

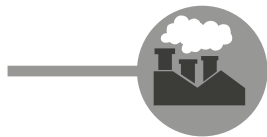
Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité				Réduction de l'intensité des émissions de carbone (sur la base des niveaux de capital investis dans une société parmi les détentions du Fonds) par rapport à l'indice de référence
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)	
Émissions de gaz à effet de serre (GES)					P
Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements					P
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P		
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales					P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E				

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Microsoft Corp	Technologie de l'information	8,93 %	États-Unis
Amazon Com Inc	Produits accessoires	6,24 %	États-Unis
Alphabet Inc Class A	Communication	5,39 %	États-Unis
Visa Inc Class A	Finance	4,69 %	États-Unis
Astrazeneca Adr Representing .5 Pl	Soins de santé	3,85 %	Royaume-Uni
Alcon Ag	Soins de santé	3,64 %	Suisse
Cardinal Health Inc	Soins de santé	3,46 %	États-Unis
Intuit Inc	Technologie de l'information	3,32 %	États-Unis
Elevance Health Inc	Soins de santé	3,10 %	États-Unis
Asml Holding Adr Representing Nv	Technologie de l'information	3,06 %	Pays-Bas
Dollar Tree Inc	Produits de consommation courante	2,86 %	États-Unis
Reckitt Benckiser Group Plc	Produits de consommation courante	2,80 %	Royaume-Uni
S&P Global Inc	Finance	2,62 %	États-Unis
Cbre Group Inc Class A	Immobilier	2,57 %	États-Unis
Sealed Air Corp	Matières premières	2,50 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

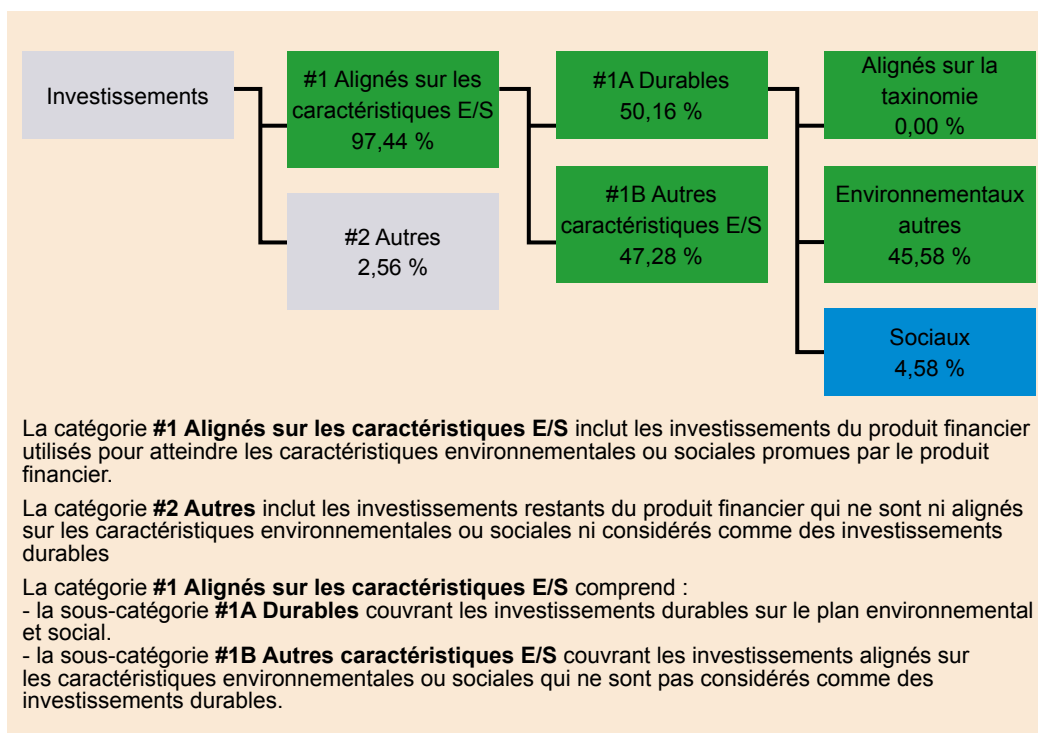
US Sustainable Equity Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Technologie de l'information	Logiciels et services	16,25 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	12,19 %
Finance	Services financiers	8,47 %
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	6,87 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	6,35 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	6,24 %
Matières premières	Matières premières	6,07 %
Communication	Médias et divertissement	5,39 %
Produits de consommation courante	Produits ménagers et de soin personnel	5,23 %
Finance	Assurance	4,54 %
Finance	Banques	4,16 %
Produits accessoires	Bien durables	3,21 %
Produits industriels	Transports	3,05 %
Produits de consommation courante	Distribution et vente au détail de produits de consommation courante	2,86 %
Immobilier	Gestion et développement de l'immobilier	2,57 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	1,66 %
Produits industriels	Biens d'équipement	1,52 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

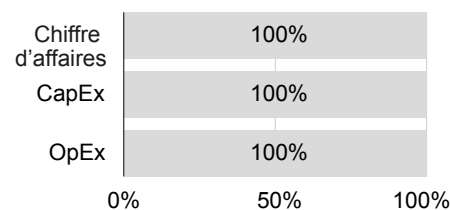
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

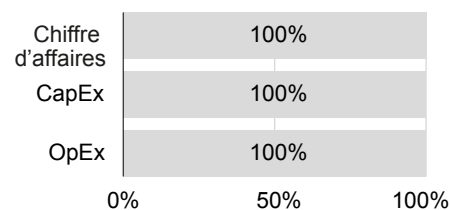
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables** aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour la période de référence, 45,58 % des investissements du Fonds ont été classés comme des investissements durables ayant un objectif environnemental non aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Fonds a investi dans des Investissements durables qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE pour les raisons suivantes : (i) cela fait partie de la stratégie d'investissement du Fonds ; (ii) les données permettant de déterminer l'alignement sur la taxinomie de l'UE étaient indisponibles ; et/ou (iii) les activités économiques sous-jacentes n'étaient pas éligibles selon les critères de sélection technique disponibles d'après la taxinomie de l'UE ou ne respectaient pas toutes les exigences énoncées dans ces critères de sélection technique.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Pour la période de référence, 4,58 % des investissements du Fonds étaient classés comme des investissements durables sur le plan social.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés et des liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852 (suite)

US Sustainable Equity Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?

Sans objet.

Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?

Sans objet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
World Financials Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493009JGB3XP8H4XV85

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bank Of America Corp	Finance	4,83 %	États-Unis
Wells Fargo	Finance	4,62 %	États-Unis
Hsbc Holdings Plc	Finance	4,47 %	Royaume-Uni
UniCredit	Finance	3,79 %	Italie
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Sa	Finance	3,72 %	Espagne
Jpmorgan Chase & Co	Finance	2,66 %	États-Unis
Intesa Sanpaolo	Finance	2,64 %	Italie
Lloyds Banking Group Plc	Finance	2,51 %	Royaume-Uni
Citizens Financial Group Inc	Finance	2,42 %	États-Unis
BLK ICS Usd Leaf Agency Dist	Finance	2,39 %	Irlande
Apollo Global Management Inc	Finance	2,34 %	États-Unis
American International Group Inc	Finance	2,33 %	États-Unis
Kkr And Co Inc	Finance	2,31 %	États-Unis
Banco Comercial Portugues Sa	Finance	2,30 %	Portugal
Synchrony Financial	Finance	2,29 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

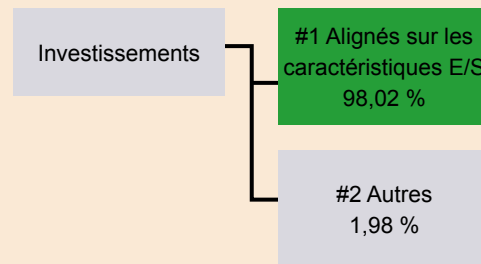
World Financials Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Finance	Banques	59,31 %
Finance	Services financiers	33,09 %
Finance	Assurance	5,04 %
Technologie de l'information	Logiciels et services	2,96 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

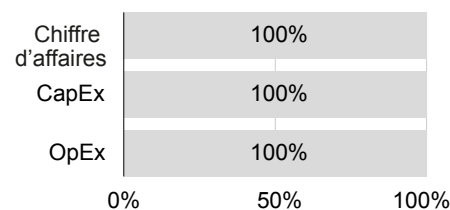
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

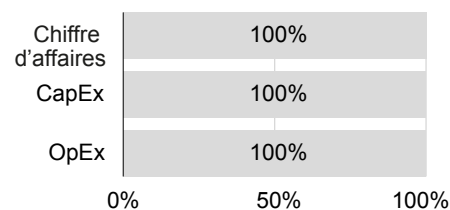
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental** au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Financials Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
World Healthscience Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300OHN1ZT4WMEMU83

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui **Non**

<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___%	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social <input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables
--	---

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétroliers (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Unitedhealth Group Inc	Soins de santé	6,77 %	États-Unis
Eli Lilly	Soins de santé	4,96 %	États-Unis
Astrazeneca Plc	Soins de santé	4,20 %	Royaume-Uni
Merck & Co Inc	Soins de santé	4,13 %	États-Unis
Novo Nordisk Class B	Soins de santé	4,02 %	Danemark
Johnson & Johnson	Soins de santé	3,74 %	États-Unis
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	3,54 %	États-Unis
Roche Holding Par Ag	Soins de santé	3,47 %	Suisse
Boston Scientific Corp	Soins de santé	3,16 %	États-Unis
AbbVie, Inc.	Soins de santé	2,81 %	États-Unis
Sanofi Sa	Soins de santé	2,76 %	France
Danaher Corp	Soins de santé	2,39 %	États-Unis
Amgen Inc	Soins de santé	2,34 %	États-Unis
Intuitive Surgical Inc	Soins de santé	2,27 %	États-Unis
Pfizer Inc	Soins de santé	2,23 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

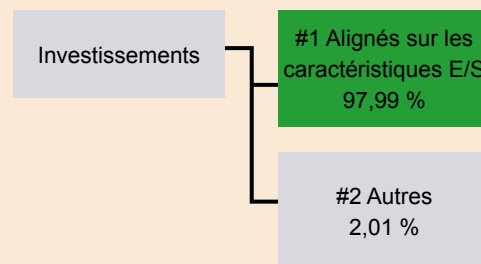
World Healthscience Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Soins de santé	Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie	61,73 %
Soins de santé	Équipement de soins de santé et services	36,24 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

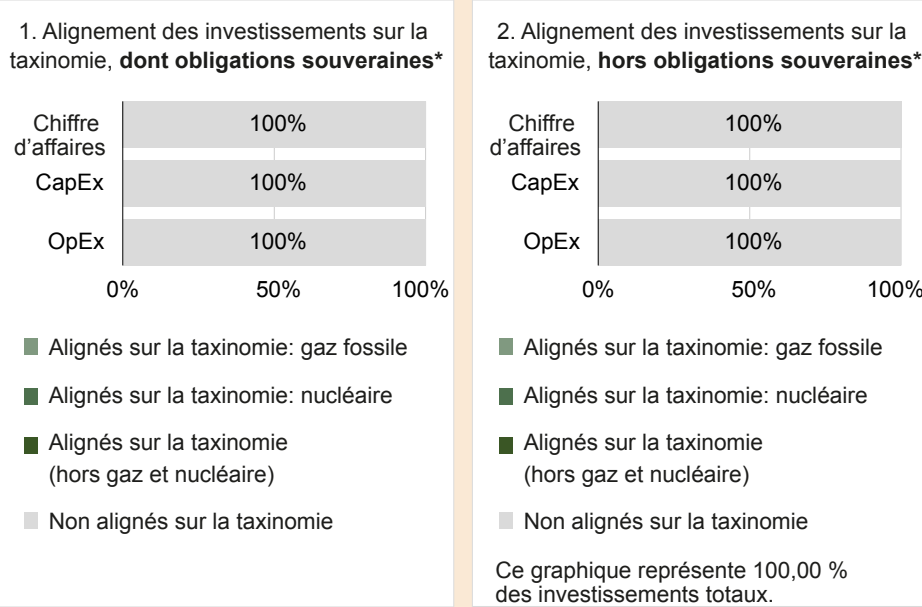
Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental** au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments dérivés, des liquidités et des quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Healthscience Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
World Technology Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493007T8WWG2QURHU23

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund (suite)

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Le Fonds utilise la méthodologie EMEA Baseline Screens with Fundamental Insights de BlackRock. Le Fonds peut investir, dans une mesure limitée, dans des émetteurs exposés aux armes nucléaires, aux combustibles fossiles, au tabac et aux armes à feu civiles. Ces investissements se basent sur le fait que ces émetteurs sont en « transition » et ont pour objectif le respect des critères de durabilité. Les émetteurs qui ne répondent pas aux critères de sélection ci-dessous sont néanmoins exclus de l'investissement.

Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)

Exclusion des émetteurs qui tirent des revenus d'une implication directe dans la production d'ogives nucléaires

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leurs revenus de la production de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)

Exclusion des émetteurs qui produisent des produits de tabac

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la distribution et de la fourniture de gros de produits liés au tabac

Exclusion des émetteurs domiciliés aux États-Unis qui produisent des armes à feu et/ou des munitions pour armes légères destinées à la vente au détail à des civils

Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 5 % de leurs revenus de la production ou de la distribution au détail d'armes à feu et/ou de munitions pour armes légères destinées à un usage civil

Exclusion des émetteurs qui sont réputés ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations Unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund (suite)

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

Indicateur de durabilité	Élément de mesure	Performance pour la période de référence
Exclusion des émetteurs sur la base des critères d'exclusion définis dans le tableau « Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds » ci-dessus.	Nombre de violations actives	Aucune violation active

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund (suite)



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Gestionnaire Financier par délégation a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité	Indicateur de durabilité			
	Exclusion des émetteurs qui sont engagés dans ou autrement exposés à la production d'armes controversées (y compris, mais sans s'y limiter, de munitions à fragmentation, d'armes biologiques-chimiques, de mines terrestres, d'uranium appauvri, d'armes à laser aveuglantes, de fragments indétectables et/ou d'armes incendiaires)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de la production et de la génération de sables pétrolifères (aussi appelés « sables bitumineux »)	Exclusion des émetteurs qui tirent plus de 25 % de leur revenu de l'extraction de charbon thermique et/ou de la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exception des « obligations vertes » de ces émetteurs, qui sont considérées comme conformes aux Principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Markets Association	Exclusion des émetteurs qui ne pas avoir respecté les principes du Pacte mondial des Nations unies (qui englobent les droits de l'homme, les normes du travail, l'environnement et la lutte contre la corruption)
Exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles		P	P	
Violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales				P
Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques ou armes biologiques)	E			

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund (suite)



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er septembre 2022 au 31 août 2023.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Apple Inc	Technologie de l'information	8,47 %	États-Unis
Microsoft Corp	Technologie de l'information	8,32 %	États-Unis
Nvidia Corp	Technologie de l'information	5,57 %	États-Unis
ASML Holding NV	Technologie de l'information	3,07 %	Pays-Bas
Mastercard Inc Class A	Finance	3,00 %	États-Unis
Cadence Design Systems Inc	Technologie de l'information	2,96 %	États-Unis
Tesla Inc	Produits accessoires	2,77 %	États-Unis
Visa Inc Class A	Finance	2,73 %	États-Unis
Alphabet Inc Class A	Communication	2,35 %	États-Unis
Broadcom Inc	Technologie de l'information	2,25 %	États-Unis
Advanced Micro Devices Inc	Technologie de l'information	2,18 %	États-Unis
Oracle Corp	Technologie de l'information	1,90 %	États-Unis
Amazon Com Inc	Produits accessoires	1,80 %	États-Unis
Lam Research Corp	Technologie de l'information	1,70 %	États-Unis
Meta Platforms Inc Catégorie A	Communication	1,69 %	États-Unis

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

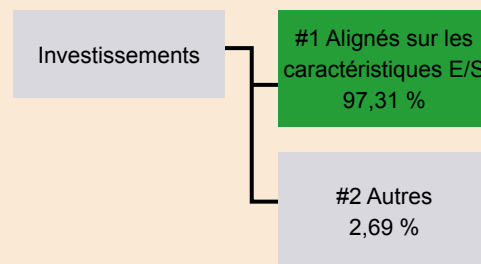
World Technology Fund (suite)



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund (suite)

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques qui représentent 1 % ou plus des investissements détenus et auxquels le Fonds a été exposé pendant la période de référence.

Secteur	Sous-secteur	% des investissements
Technologie de l'information	Logiciels et services	30,18 %
Technologie de l'information	Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur	26,85 %
Technologie de l'information	Matériel et équipement technologiques	11,83 %
Finance	Services financiers	8,83 %
Communication	Médias et divertissement	8,08 %
Produits accessoires	Distribution et vente au détail de produits accessoires	4,28 %
Produits accessoires	Automobiles et composants	2,87 %
Produits industriels	Services commerciaux et professionnels	1,03 %
Produits accessoires	Services aux consommateurs	1,01 %

Au cours de la période de référence, le Fonds ne détenait aucun investissement dans les sous-secteurs suivants (définis par le Global Industry Classification System) : gaz et pétrole intégrés, exploration et production de pétrole et de gaz, forage gazier et pétrolier, équipements et services liés au pétrole et au gaz, stockage et transport de pétrole et de gaz, raffinage et commercialisation de pétrole et de gaz, charbon et combustibles.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund (suite)

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

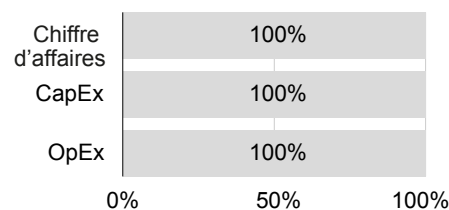
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

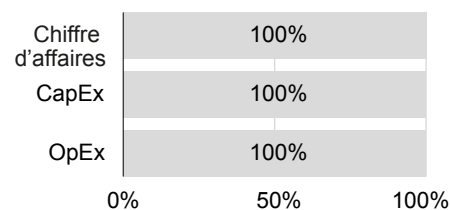
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund (suite)

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Pour la période de référence, 0 % des investissements du Fonds ont été réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental** au titre du Règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » comprenaient des instruments de liquidités et de quasi-liquidités, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture. Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Gestionnaire Financier par délégation a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Gestionnaire Financier par délégation contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Gestionnaire Financier par délégation, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable, selon l'implication directe du Gestionnaire Financier par délégation avec l'émetteur. Le Gestionnaire Financier par délégation peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

Le Gestionnaire Financier par délégation est également soumis aux exigences en matière de participation des actionnaires de la Directive sur les droits des actionnaires II (SRD). La SRD vise à renforcer la position des actionnaires et la transparence, ainsi qu'à réduire les risques excessifs au sein des sociétés négociées sur les marchés réglementés de l'UE. De plus amples informations concernant les activités du Gestionnaire Financier par délégation dans le cadre de la SRD sont disponibles sur le site de BlackRock à l'adresse suivante :

<https://www.blackrock.com/uk/professionals/solutions/shareholder-rights-directive>.

Annexe IV – Informations complémentaires (non révisé) (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

World Technology Fund (suite)



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● **En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Sans objet.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Sans objet.

Vous voulez en savoir davantage ?

blackrockinternational.com | +44 (0)20 7743 3300

© 2023 BlackRock, Inc. Tous droits réservés. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS et iSHARES sont des marques de BlackRock, Inc. ou de ses filiales aux États-Unis et ailleurs. Toutes autres marques de commerce appartiennent à leurs détenteurs respectifs.

BlackRock

Go paperless... 
It's Easy, Economical and Green!
Go to www.icsdelivery.com